PIMCO

# PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

# Halbjahresbericht

30. Juni 2019

Eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und gesonderter Haftung der einzelnen Teilfonds, die mit beschränkter Haftung gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 eingetragen wurde und von der Central Bank of Ireland als Organismus für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren), in der jeweils geltenden Fassung, und nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren, OGAW) von 2011 genehmigt wurde.

A company of Allianz

## ALLGEMEINE KENNDATEN

**Fondstyp:**
OGAW

**Anzahl an Teilfonds der Gesellschaft:**
60 Teilfonds

**Zum 30. Juni 2019 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 DKK (Partially 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 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 CHF (Unhedged)
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)
E Class USD (Unhedged)
G Institutional
G Institutional EUR (Hedged)
G Institutional EUR (Partially Hedged)
G Institutional EUR (Unhedged)
G Retail EUR (Hedged)
G Retail EUR (Unhedged)
H Institutional
H Institutional EUR (Hedged)
M Retail
M Retail AUD (Hedged)
M Retail HKD (Unhedged)
M Retail SGD (Hedged)
R Class
R Class EUR (Hedged)
R Class GBP (Hedged)
R Class SEK (Hedged)
T Class
T Class EUR (Hedged)
Z Class
Z Class AUD (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. Innerhalb der Investor Classes dürfen der Income Fund und der Low Duration Income Fund auch ausschüttende A-Anteile (Anteile, die auf jährlicher Basis einen Ertrag ausschütten) ausgeben.

**Nettovermögen (Angaben in Tausend):**
USD 176.624.980

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

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

**Funktionswährung der Teilfonds:**
USD ($), mit Ausnahme der Teilfonds UK Corporate Bond Fund und UK Long Term Corporate Bond Fund, die auf Pfund Sterling (£) lauten, sowie der Teilfonds Dynamic Multi-Asset Fund, Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, Euro Low Duration Fund, Euro Short-Term Fund, PIMCO RAE Europe Fund und PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund, die auf Euro (€) lauten.

* Eine vollständige Liste aller während des aktuellen und vorangegangenen Berichtszeitraums für die einzelnen Teilfonds angebotenen Anteilsklassen ist Erläuterung 15 zu entnehmen. Eine vollständige und umfassende Liste aller von den einzelnen Teilfonds angebotenen Anteilsklassen ist dem Prospekt zu entnehmen.

## ALLGEMEINE KENNDATEN (Forts.)

### Zulassung in Hongkong:

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

PIMCO Capital Securities Fund
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund
Dynamic Bond Fund
Dynamic Multi-Asset Fund
Diversified Income Duration Hedged Fund
Emerging Markets Corporate Bond Fund
Euro Bond Fund
Euro Credit Fund
Euro Income Bond Fund
Euro Long Average Duration Fund
Euro Low Duration Fund
Euro Short-Term Fund
Global Advantage Fund
Global Advantage Real Return Fund
Global Bond ESG Fund
Global Bond Ex-US Fund
Global Investment Grade Credit ESG Fund
Global Libor Plus Bond Fund
Global Low Duration Real Return Fund
Global Multi-Asset Fund
Inflation Strategy Fund
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund
Low Duration Income Fund
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund
Mortgage Opportunities Fund
PIMCO RAE Emerging Markets Fund
PIMCO RAE Europe Fund
PIMCO RAE Global Developed Fund
PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund
PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund
StocksPLUS™ Fund
Strategic Income Fund
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
UK Corporate Bond Fund
UK Long Term Corporate Bond Fund
US Investment Grade Corporate Bond Fund
US Short-Term Fund

### Zulassung in Singapur

Die folgenden Teilfonds werden von der Monetary Authority of Singapore 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
Dynamic Multi-Asset Fund
Euro Credit Fund
Euro Income Bond Fund
Euro Long Average Duration Fund
Euro Low Duration Fund
Euro Short-Term 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 RAE Emerging Markets Fund
PIMCO RAE Europe Fund
PIMCO RAE Global Developed Fund
PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund
PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund
PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund
Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
UK Corporate Bond Fund
UK Long Term Corporate Bond Fund
US Short-Term Fund

### Reuters-Seite:

PAFPPLC

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

# Inhaltsverzeichnis


| | Seite |
|---|---|
| Schreiben des Vorsitzenden* | 4 |
| Wichtige Angaben zu den Teilfonds | 5 |
| Beschreibungen der Vergleichsindizes | 73 |
| Finanzstatus | 80 |
| Betriebsergebnisrechnung | 102 |
| Ausweis der Nettovermögensänderungen | 122 |
| Aufstellung der Wertpapieranlagen | 128 |
| Erläuterungen zum Abschluss | 750 |
| Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung | 805 |
| Begriffsbestimmungen | 864 |
| Allgemeine Informationen | 866 |

| TEILFONDS | Teilfonds-überblick* | Aufstellung der Wert-papieranlagen |
|---|---|---|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | 6 | 128 |
| PIMCO Capital Securities Fund | 7 | 133 |
| Commodity Real Return Fund | 9 | 142 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 10 | 154 |
| Diversified Income Fund | 11 | 162 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 13 | 180 |
| Dynamic Bond Fund | 14 | 193 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | 15 | 207 |
| Emerging Asia Bond Fund | 16 | 216 |
| Emerging Local Bond Fund | 17 | 221 |
| Emerging Markets Bond Fund | 18 | 237 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 19 | 250 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 20 | 256 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 21 | 261 |
| Euro Bond Fund | 22 | 271 |
| Euro Credit Fund | 23 | 280 |
| Euro Income Bond Fund | 24 | 288 |
| Euro Long Average Duration Fund | 25 | 298 |
| Euro Low Duration Fund | 26 | 305 |
| Euro Short-Term Fund | 27 | 310 |
| Global Advantage Fund | 28 | 315 |
| Global Advantage Real Return Fund | 29 | 334 |
| Global Bond Fund | 30 | 345 |
| Global Bond ESG Fund | 32 | 371 |
| Global Bond Ex-US Fund | 33 | 384 |
| Global High Yield Bond Fund | 34 | 400 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 35 | 410 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | 38 | 436 |
| Global Libor Plus Bond Fund | 39 | 444 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 40 | 455 |
| Global Multi-Asset Fund | 41 | 465 |
| Global Real Return Fund | 42 | 481 |
| Income Fund | 43 | 493 |
| Inflation Strategy Fund | 45 | 529 |
| Low Average Duration Fund | 46 | 540 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 47 | 548 |
| Low Duration Income Fund | 48 | 558 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 49 | 568 |
| Mortgage Opportunities Fund | 50 | 572 |
| PIMCO RAE Emerging Markets Fund | 51 | 583 |
| PIMCO RAE Europe Fund | 52 | 590 |
| PIMCO RAE Global Developed Fund | 53 | 595 |
| PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | 54 | 603 |

| TEILFONDS | Teilfonds-überblick* | Aufstellung der Wert-papieranlagen |
|---|---|---|
| PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | 55 | 608 |
| PIMCO RAE US Fund | 56 | 614 |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund | 57 | 617 |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund | 58 | 624 |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund | 59 | 629 |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund | 60 | 636 |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 61 | 642 |
| StocksPLUS™ Fund | 62 | 652 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 63 | 662 |
| Strategic Income Fund | 64 | 665 |
| Total Return Bond Fund | 65 | 682 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 67 | 695 |
| UK Corporate Bond Fund | 68 | 703 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 69 | 711 |
| US High Yield Bond Fund | 70 | 719 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 71 | 728 |
| US Short-Term Fund | 72 | 740 |


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

* Dieses Dokument enthält die Meinungen der 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.
©2019, PIMCO.

# Schreiben des Vorsitzenden

**Sehr geehrte Anteilinhaber,**

Im Anschluss an dieses Schreiben folgt der Halbjahresbericht von PIMCO Funds: Global Investors Series plc, der den am 30. Juni 2019 abgeschlossenen sechsmonatigen 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 sechsmonatigen Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019**

Die Weltwirtschaft setzte ihre Expansion fort, das Tempo schwächte sich jedoch allgemein ab. Dem Internationalen Währungsfonds („IWF“) zufolge wird für 2019 mit einem weltweiten Wachstum von 3,3 % gerechnet, verglichen mit 3,6 % im Jahr 2018. Aus regionaler Sicht wird erwartet, dass die US-Wirtschaft 2019 um 2,3 % wachsen wird, verglichen mit 2,9 % im Vorjahr. In der Eurozone, Großbritannien und Japan schätzte der IWF das BIP-Wachstum im Jahr 2019 derweil auf jeweils 1,3 % bzw. 1,2 % bzw. 1,0 %. Zum Vergleich: 2018 verzeichneten diese Länder jeweils ein Wachstum von 1,8 % bzw. 1,4 % bzw. 0,8 %.

Vor diesem Hintergrund hielten die Europäische Zentralbank (EZB) und die Bank of Japan weitgehend an ihrer äußerst lockeren Geldpolitik fest. Die EZB beendete ihr Programm zur quantitativen Lockerung im Dezember 2018 und ließ durchblicken, dass sie damit rechnet, ihre Zinsen „mindestens bis Ende des ersten Halbjahres 2020“ unverändert zu belassen. Die Bank of England beließ ihre Zinsen derweil während des Berichtszeitraums unverändert.

Nachdem sie ihre Zinsen 2018 viermal angehoben hatte, nahm die US-Notenbank (Federal Reserve, Fed) eine Kurskorrektur vor und schwenkte auf eine gemäßigte Geldpolitik um. Im Nachhinein betrachtet hatte die Fed die Leitzinsen mit der im Dezember 2018 durchgeführten Zinserhöhung auf eine Spanne von 2,25 % bis 2,50 % erhöht. Bei ihrer im Januar 2019 abgehaltenen Sitzung dämpfte die Fed jedoch ihre Erwartungen bezüglich des Tempos weiterer Zinserhöhungen im Laufe des Jahres 2019. Nach der im Juni 2019 abgehaltenen Sitzung der Fed erklärte der Vorsitzende Jerome Powell dann, die Argumente für eine etwas gelockerte Geldpolitik seien stärker geworden. Diese Ausrichtung wurde teilweise Handelsspannungen und Anzeichen auf eine Abkühlung des weltweiten Wachstums (einschließlich schwächer werdender Fertigungsdaten) zugeschrieben. Bei ihrer Sitzung am 31. Juli 2019, nach Ablauf des Berichtszeitraums, senkte die US-Notenbank die Leitzinsen schließlich auf eine Spanne von 2,00 % bis 2,25 %. Dies war die erste Zinssenkung der Fed seit 2008.

Sowohl die kurz- als auch die langfristigen Renditen auf US-Staatsanleihen sanken. Unserer Einschätzung nach war der Rückgang der Zinsen teilweise auf Anzeichen auf eine Abschwächung des weltweiten Wachstums sowie auf den Umschwung der Fed auf eine gemäßigte Geldpolitik und Phasen erhöhter Risikoaversion unter Anlegern zurückzuführen. Die Rendite auf zweijährige US-Staatsanleihen lag zum Ende des Berichtszeitraums bei 1,75 %, verglichen mit 2,48 % am 31. Dezember 2018. Die Rendite auf die als Benchmark angesetzten 10-jährigen US-Staatsanleihen lag zum Ende des Berichtszeitraums derweil bei 2,00 %, nachdem sie zum 31. Dezember 2018 noch 2,69 % 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 5,52 %. Der Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD hedged), ein weitläufig verwendeter Index für globale Anleihen mit Investment Grade-Rating, rentierte derweil mit 8,22 %. Mit höherem Risiko behaftete festverzinsliche Anlageklassen wie etwa hochverzinsliche Unternehmensanleihen und Schuldtitel aus Schwellenländern lieferten ebenfalls positive Ergebnisse. 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 10,05 %, während Auslandsschulden von Schwellenländern, die vom JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (USD hedged) abgebildet werden, mit 10,60 % rentierten. Auf Landeswährungen lautende Schwellenmarktanleihen, die vom JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) abgebildet werden, rentierten mit 8,72 %.

Globale Aktien erzielten allgemein starke Ergebnisse. Trotz Phasen erhöhter Volatilität legten US-Aktien deutlich zu. Wir gehen davon aus, dass diese Rally auf mehrere Faktoren zurückzuführen war, unter anderem auf Unternehmensgewinne, die häufig über den Erwartungen lagen, sowie auf die gemäßigtere Haltung der Fed. US-Aktien verzeichneten gemessen am S&P 500-Index insgesamt ein Plus von 18,54 %. Die am MSCI Emerging Markets Index gemessenen Schwellenmarktaktien rentierten mit 10,59 %, während globale Aktien gemessen am MSCI World Index eine Rendite von 16,98 % erzielten. Japanische Aktien verbuchten derweil am Nikkei 225 Index (in JPY) gemessen ein Plus von 7,53 %, während die vom MSCI Europe Index (in EUR) abgebildeten europäischen Aktien mit 16,24 % rentierten.

Die Rohstoffpreise waren Schwankungen ausgesetzt und legten größtenteils zu. Zu Beginn des Berichtszeitraums notierte Brent-Rohöl noch bei etwa 54 USD je Barrel, zum Ende lag der Preis jedoch bei ca. 67 USD je Barrel. Auch die Gold- und Kupferpreise tendierten aufwärts.

An den Devisenmärkten schließlich wurden Phasen erhöhter Volatilität verzeichnet, was teilweise auf Anzeichen auf eine Abschwächung des weltweiten Wirtschaftswachstums, eine veränderte geldpolitische Ausrichtung der Zentralbanken sowie eine Reihe geopolitischer Ereignisse zurückzuführen war. Der US-Dollar legte gegenüber dem Euro und dem britischen Pfund jeweils um 0,82 % bzw. 0,45 % zu. Gegenüber dem japanischen Yen gab der US-Dollar jedoch um 1,71 % nach.

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

Mit freundlichem Gruß

Craig A. Dawson
Vorsitzender

Die angegebene Performance stellt die Wertentwicklung in der Vergangenheit dar. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit bietet keine Garantie für künftige Ergebnisse. Sofern nichts Anderweitiges angegeben ist, spiegeln Indexrenditen die Wiederanlage etwaiger Ertragsausschüttungen und Kapitalgewinne wider; Gebühren, Maklerprovisionen und sonstige Anlagekosten bleiben jedoch unberücksichtigt. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen.

## Wichtige Angaben zu den Teilfonds

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

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

Die Teilfonds können zusätzlich zu den vorstehend 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 Hochzinspapieren verbundenen Risiken sowie die mit einem bestimmten Sektor einhergehenden Anlagerisiken. Die Teilfonds dürfen zu Absicherungszwecken oder als Teil einer Anlagestrategie derivative Instrumente verwenden. Der Einsatz dieser Instrumente kann mit bestimmten Kosten und Risiken einhergehen, wie zum Beispiel Liquiditätsrisiko, Zinssatzrisiko, Marktrisiko, Kreditrisiko, Verwaltungsrisiko und dem Risiko, dass ein Teilfonds eine Position nicht dann glattstellen kann, wenn es für ihn am vorteilhaftesten wäre. Teilfonds, die in derivative Instrumente anlegen, können einen höheren Betrag als den in diese Instrumente angelegten Kapitalbetrag verlieren. Anlagen in Auslandswerten können Risiken bergen, die von den ausländischen wirtschaftlichen und politischen Entwicklungen abhängen. Dieses Risiko kann bei Anlagen in Schwellenmärkten steigen. Hochzinsanleihen erhalten grundsätzlich eine niedrigere Bonitätsbewertung als andere Anleihen. Anleihen mit niedrigerem Rating sind in der Regel in Bezug auf das Anleihekapital mit einem höheren Risiko behaftet als höher bewertete Anleihen. Kleinere Unternehmen können schwankungsanfälliger als größere Unternehmen und deshalb mit einem höheren Risiko verbunden sein. Auch die Konzentration von Anlagen auf einzelne Sektoren kann im Gegensatz zu einem diversifizierten Teilfonds mit einem zusätzlichen Risiko und einer zusätzlichen Volatilität einhergehen.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit bietet keine Garantie für künftige Ergebnisse. Die Überblicksseiten der einzelnen Teilfonds 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 Teilfonds oder (ii) die Rückgabe von Investmentanteilen des Teilfonds zu zahlen hat, nicht berücksichtigt. Die aktuelle Wertentwicklung kann geringer oder höher ausfallen als die angeführten Wertentwicklungsdaten. Sämtliche Teilfondserträge verstehen sich nach Gebühren und Aufwendungen.

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

PIMCO Funds: Global Investors Series plc wird vertrieben von PIMCO Europe Ltd, 11 Baker Street, London W1U 3AH, Vereinigtes Königreich; 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.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | — | 5,70 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | — | 5,73 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | — | 5,54 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | — | 5,38 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019) | — | 5,37 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | — | 6,00 % |
| JP Morgan JACI Non-Investment Grade | — | 5,55 % |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | — | 4,87 % |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019) | — | 4,85 % |
| JP Morgan JACI Non-Investment Grade (HKD Unhedged) | — | 5,08 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2019) | — | 5,08 % |
| M Retail SGD (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 14. Feb. 2019) | — | 5,06 % |
| JP Morgan JACI Non-Investment Grade (SGD Hedged) | — | 5,31 % |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund strebt eine maximale Gesamtrendite bei umsichtiger Anlageverwaltung an, indem er in einen Mix aus festverzinslichen Instrumenten von Emittenten, die wirtschaftlich mit asiatischen Ländern, ausgenommen Japan, verbunden sind, sowie verbundenen Derivaten auf diese Wertpapiere investiert. Vom Teilfonds gekaufte Rentenwerte sind von Moody's mindestens mit C oder von S&P bzw. Von 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.

Der Fonds hat die Geschäftstätigkeit am 14. Februar 2019 aufgenommen.

## Kommentare zum Fonds

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

» Eine Übergewichtung von Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen sanken.

» Eine Untergewichtung hochverzinslicher asiatischer Staatsanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich staatliche Titel schwächer entwickelten als der breitere Index für asiatische Hochzinsanleihen.

» Eine Untergewichtung hochverzinslicher Anleihen asiatischer quasi-staatlicher Stellen trug zur Wertentwicklung bei, da sich Titel quasi-staatlicher Stellen schwächer entwickelten als der breitere Index für asiatische Hochzinsanleihen.

» Eine Untergewichtung Chinas belastete die Wertentwicklung, da sich China stärker entwickelte als der breitere Index für asiatische Hochzinsanleihen.

» Ein Long-Engagement bei Währungen asiatischer Schwellenländer gegenüber einer Short-Position im US-Dollar trug zur Wertentwicklung bei, da sich Währungen asiatischer Schwellenländer gegenüber dem US-Dollar stark entwickelten.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2013) | 9,91 % | 6,64 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Sep. 2014) | 9,90 % | 5,44 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2014) | 9,72 % | 4,86 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014) | 9,75 % | 4,89 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | 9,60 % | 5,99 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | 9,62 % | 5,98 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013) | 9,42 % | 5,24 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2014) | 9,45 % | 4,33 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | 9,34 % | 4,90 % |
| Class R, ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014) | 9,89 % | 5,28 % |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 9,20 % | 4,67 % |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2013) | 10,36 % | 6,96 % |
| 3 Month USD LIBOR Index | 1,36 % | 1,02 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018) | 9,11 % | 4,93 % |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Aug. 2015) | 9,86 % | 6,77 % |
| Bloomberg AusBond Bank Bills Index | 0,97 % | 1,95 %[2] |
| **Auf BRL lautende Klassen** | | |
| Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jan. 2018) | 12,50 % | (4,34 %) |
| ICE BofAML 3 Month USD LIBOR Index Hedged BRL Denominated in USD | 3,91 % | (5,07 %) |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018) | 9,10 % | 6,39 % |
| 3 Month USD LIBOR (CAD Hedged) Index | 0,95 % | 1,73 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | 7,99 % | 4,56 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Jun. 2014) | 7,55 % | 1,86 % |
| 3 Month USD LIBOR (in CHF besichert) | (0,41 %) | (0,85 %)[2] |
| **Auf CNH lautende Klassen** | | |
| Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018) | 9,66 % | 8,16 % |
| 3 Month USD LIBOR (CNH Hedged) Index | 1,34 % | 3,11 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | 8,27 % | 5,03 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | 8,21 % | 5,02 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014) | 8,24 % | 3,48 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Feb. 2016) | 8,04 % | 5,87 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | 7,88 % | 4,49 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Okt. 2013) | 7,71 % | 3,72 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | 7,74 % | 2,70 % |
| Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014) | 8,08 % | 3,10 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 7,52 % | 2,59 % |
| 3 Month Euribor | (0,15 %) | (0,12 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2013) | 8,76 % | 5,75 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2013) | 8,78 % | 5,87 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jun. 2014) | 8,64 % | 3,87 % |
| 3 Month GBP-LIBOR-Index | 0,43 % | 0,56 %[2] |

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein Engagement bei zusätzlichen Tier-1-Anleihen trug zur Wertentwicklung bei, da die Spreads zulegten.

» Ein Engagement bei AT1-Anleihen in den Peripherieländern Spanien und Italien trug zur Wertentwicklung bei.

» Ein Engagement bei vorrangigen Bankenschuldtiteln, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Ein Engagement bei Kreditabsicherungspositionen, die über Credit Default Swaps eingerichtet wurden, schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads während des Berichtszeitraums verengten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017) | 9,18 % | 3,47 % |
| 3 Month HIBOR Index | 1,06 % | 1,61 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018) | 9,31 % | 4,78 % |
| M Retail SGD (Hedged) ausschüttend II (Auflegung 23. Dez. 2013) | 9,02 % | 4,84 % |
| 3 Month SGD LIBOR Index | 1,01 % | 1,15 %[2] |

1 *Wertentwicklung auf Jahresbasis für Berichtszeiträume von mindestens einem Jahr, ansonsten kumulativ.*
2 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2006) | 7,51 % | (3,54 %) |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011) | 7,42 % | (7,30 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007) | 7,00 % | (5,21 %) |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2006) | 6,80 % | (4,34 %) |
| Bloomberg Commodity Index Total Return | 5,06 % | (4,84 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2010) | 5,63 % | (4,53 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2012) | 5,27 % | (8,58 %) |
| G Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Mrz. 2018) | 5,80 % | (6,95 %) |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (EUR Hedged) | 2,19 % | (6,17 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 2017) | 6,20 % | (4,05 %) |
| Bloomberg Commodity Index Total Return (GBP Hedged) | 3,77 % | (4,31 %) |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Commodity Real Return Fund ist bemüht, einen höchstmöglichen Gesamtertrag bei umsichtiger Anlageverwaltung zu erreichen, indem er in (börsennotierte oder im Freiverkehr (OTC) gehandelte) derivative Instrumente investiert. Hierbei kann es sich um Swaps, Futures, Optionen auf Futures und strukturierte Schuldverschreibungen sowie rohstoff-indexgebundene Schuldverschreibungen handeln, die es ihm ermöglichen, ein Engagement bei Indizes und Teilindizes (einschließlich unter anderem bei Indizes der Bloomberg Commodity-Indexfamilie) einzugehen, die sich auf Rohstoffe beziehen, die die Anforderungen der irischen Zentralbank erfüllen und gegebenenfalls von dieser freigegeben wurden. Nähere Einzelheiten zu den vom Fonds verwendeten Indizes sowie zu den Arten von Rohstoffen, auf die diese sich beziehen, sind auf Anfrage von der Anlageverwaltungs-gesellschaft 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Eine Übergewichtung der US-Realduration trug zur Wertentwicklung bei, da die US-Realrenditen zurückgingen.

» Ein Engagement bei verbrieften Produkten trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Eine Übergewichtung der deutschen nominalen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die deutschen Nominalrenditen zurückgingen.

» Eine Untergewichtung der nominalen US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die US-Nominalrenditen sanken.

» Eine Untergewichtung der französischen nominalen Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die französischen Nominalrenditen sanken.

# PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011) | 6,26 % | 3,72 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012) | 5,81 % | 1,88 % |
| 3 Month USD LIBOR Index | 1,36 % | 0,88 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2012) | 4,47 % | 1,11 % |
| 3 Month USD LIBOR (in CHF besichert) | (0,41 %) | (0,78 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2011) | 4,63 % | 2,61 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013) | 4,73 % | 1,79 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012) | 4,20 % | 0,63 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 4,02 % | 0,19 % |
| 3 Month Euribor | (0,15 %) | 0,06 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO Credit Opportunities Bond Fund strebt unter Schutz des Kapitals und umsichtiger Anlageverwaltung in verschiedenen Marktumgebungen eine positive Gesamtrendite an, indem er mindestens 80 % seines Nettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio von Renteninstrumenten investiert. Der Teilfonds bemüht sich um einen positiven Gesamtertrag, und nicht um einen Ertrag, der einen bestimmten Vergleichsindex übertrifft. Er zielt unabhängig davon, ob die Märkte steigen oder sinken, auf die Generierung absoluter Erträge ab.

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein Long-Engagement bei US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinsen sanken.

» Ein Long-Engagement bei Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor positive Gesamtrenditen erzielte.

» Ein Long-Engagement im Baustoffsektor trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor positive Gesamtrenditen erzielte.

» Ein Short-Engagement bei europäischer Duration belastete die Wertentwicklung, da die Zinsen sanken.

» Ein Short-Engagement im Einzelhandelssektor schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor positive absolute Renditen verbuchte.

# Diversified Income Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005) | 10,08 % | 6,80 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Sep. 2008) | 10,08 % | 7,29 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Apr. 2013) | 9,80 % | 4,19 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2013) | 9,87 % | 4,18 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011) | 9,80 % | 5,30 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006) | 9,57 % | 5,92 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006) | 9,59 % | 6,01 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2011) | 9,98 % | 5,61 % |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010) | 9,64 % | 5,12 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | 9,62 % | 4,81 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 9,31 % | 4,34 % |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 9,38 % | 4,33 % |
| jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged[3] | 9,66 % | 6,34 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mai 2019) | — | 2,70 % |
| M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012) | 9,06 % | 5,10 % |
| jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, AUD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, AUD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, AUD Hedged[3] | 9,11 % | 5,70 % |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2019) | — | 5,70 % |
| jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, CAD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, CAD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, CAD Hedged[3] | — | 5,08 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011) | 8,18 % | 4,17 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012) | 8,19 % | 3,39 % |
| jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, CHF Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, CHF Hedged; und JPMorgan EMBI Global, CHF Hedged[3] | 7,77 % | 3,96 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2007) | 8,38 % | 5,96 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Okt. 2007) | 8,31 % | 6,08 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2007) | 8,14 % | 5,86 % |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013) | 8,14 % | 3,07 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jul. 2007) | 8,09 % | 5,71 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jul. 2007) | 7,93 % | 5,32 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2009) | 7,94 % | 4,97 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 7,69 % | 2,42 % |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 7,67 % | 2,41 % |
| jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, EUR Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, EUR Hedged; und JPMorgan EMBI Global, EUR Hedged[3] | 7,97 % | 5,20 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2006) | 8,97 % | 6,80 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Feb. 2006) | 9,10 % | 6,70 % |
| Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2011) | 8,65 % | 4,80 % |
| jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, GBP Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, GBP Hedged; und JPMorgan EMBI Global, GBP Hedged[3] | 8,54 % | 6,04 %[2] |

## 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Die Titelauswahl im Bankensektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Eine Übergewichtung im hochverzinslichen Mediensektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Eine Übergewichtung bei Finanzdienstleistungsfirmen wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich der Sektor während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte.

» Eine Untergewichtung bei Schwellenmarktschuldtiteln war der Wertentwicklung abträglich, da die Spreads während des Berichtszeitraums zunahmen.

» Ein untergewichtetes Engagement im hochverzinslichen Rohstoffsektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, war der Wertentwicklung abträglich.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 8,50 % | 6,22 % |
| jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, SEK Hedged; ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SEK Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SEK Hedged[3] | 8,16 % | 5,49 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019) | — | 2,74 % |
| jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, SGD Hedged; ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, SGD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, SGD Hedged[3] | — | 2,59 % |

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex repräsentiert: Von der Auflegung bis zum 9. November 2015 jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Component USD Hedged; ICE BofAML Global High Yield BB-B Rated Constrained USD Hedged; JPMorgan EMBI Global. Seit dem 10. November 2015 jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged.*

# Diversified Income Duration Hedged Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2011) | 6,53 % | 4,27 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | 6,53 % | 5,98 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 6,38 % | 3,18 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 6,34 % | 3,16 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2013) | 6,03 % | 2,83 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2011) | 6,08 % | 3,38 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 5,83 % | 2,88 % |
| 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[3] | 5,72 % | 3,59 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2011) | 4,92 % | 3,60 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013) | 4,93 % | 2,30 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Aug. 2011) | 4,44 % | 2,84 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2013) | 4,45 % | 0,90 % |
| Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter 0,25-Jahres-Duration: jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, EUR Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, EUR Hedged; und JPMorgan EMBI Global, EUR Hedged[3] | 4,07 % | 3,14 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Aug. 2011) | 5,47 % | 4,44 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2013) | 5,47 % | 2,73 % |
| Eine Mischung aus folgenden drei Indizes bei konstanter 0,25-Jahres-Duration: jeweils 1/3 Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, GBP Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, GBP Hedged; und JPMorgan EMBI Global, GBP Hedged[3] | 4,55 % | 3,79 %[2] |

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

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

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

» Die Titelauswahl im Bankensektor, in dem sich ausgewählte Emittenten überdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Ein übergewichtetes Engagement bei der USD-Duration wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Zinssätze im Laufe des Berichtszeitraums stiegen.

» Eine Übergewichtung im hochverzinslichen Mediensektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Eine Untergewichtung bei Schwellenmarkt-schuldtiteln war der Wertentwicklung abträglich, da die Spreads während des Berichtszeitraums zunahmen.

» Ein untergewichtetes Engagement im hochverzinslichen Rohstoffsektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, war der Wertentwicklung abträglich.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2008) | 3,46 % | 3,07 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Feb. 2010) | 3,42 % | 2,65 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010) | 3,25 % | 1,88 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Sep. 2010) | 3,25 % | 1,87 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010) | 3,15 % | 2,12 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Mai 2010) | 2,95 % | 1,56 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 11. Mai 2010) | 2,93 % | 1,57 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | 3,29 % | 3,60 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 3,31 % | 1,81 % |
| 1 Month USD LIBOR Index | 1,25 % | 0,62 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Mrz. 2014) | 3,45 % | 4,54 % |
| Bloomberg AusBond Bank Bills Index | 0,97 % | 2,12 % |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018) | 3,00 % | 3,10 % |
| 1 Month LIBOR Index (CAD Hedged) | 0,78 % | 1,17 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2010) | 1,60 % | 0,86 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 18. Apr. 2011) | 1,22 % | (0,07 %) |
| 1 Month CHF LIBOR Index | (0,40 %) | (0,38 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2009) | 1,84 % | 2,42 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Dez. 2009) | 1,87 % | 1,91 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2011) | 1,76 % | 1,10 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2010) | 1,67 % | 1,31 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Nov. 2009) | 1,39 % | 0,98 % |
| G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 14. Dez. 2010) | 1,42 % | 0,60 % |
| 1 Month Euribor Index | (0,18 %) | 0,14 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Dez. 2009) | 2,45 % | 2,40 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Feb. 2012) | 2,52 % | 2,08 % |
| Class E GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 2010) | 1,98 % | 1,34 % |
| 1 Month GBP-LIBOR-Index | 0,37 % | 0,53 %[2] |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Apr. 2011) | 2,55 % | 2,73 % |
| 1 Month NIBOR Rate Index | 0,58 % | 1,43 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Mrz. 2018) | 1,98 % | 0,79 % |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Nov. 2011) | 1,73 % | 1,35 % |
| 1 Month SEK LIBOR Index | (0,10 %) | 0,26 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Long-Positionen bei US-Nominalzinsen, vor allem am 5- und 7-jährigen Abschnitt der Kurve, trugen zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein Engagement in US-Barzinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die kurzfristigen Zinsen positiv blieben.

» Ein Long-Engagement bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug während eines Großteils des Berichtszeitraums zur Wertentwicklung bei. Der Bloomberg Barclays U.S. Corporate Bond Index, der den Markt für festverzinsliche, steuerpflichtige Unternehmensanleihen mit Investment Grade abbildet, verbuchte positive Renditen.

» Ein Long-Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da der Bloomberg Barclays U.S. Corporate High Yield Index, der den Markt für hochverzinsliche, festverzinsliche Unternehmensanleihen abbildet, positive Renditen verbuchte.

» Ein Short-Engagement bei italienischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Ein Short-Engagement bei britischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016) | 5,19 % | 3,89 % |
| Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 25. Feb. 2016) | 5,19 % | 3,89 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016) | 4,58 % | 2,78 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 8. Dez. 2017) | 4,63 % | (1,80 %) |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2016) | 4,37 % | 0,96 % |
| 1 Month Euribor Index | (0,18 %) | (0,36 %)[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018) | 5,07 % | (0,46 %) |
| 1 Month CHF LIBOR Index | (0,40 %) | (0,78 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016) | 5,68 % | 4,86 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019) | — | 3,79 % |
| 1 Month GBP-LIBOR-Index | 0,37 % | 0,48 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Feb. 2016) | 6,79 % | 6,31 % |
| Class E USD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Mrz. 2017) | 6,24 % | 3,12 % |
| 1 Month USD LIBOR Index | 1,25 % | 1,42 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein Long-Engagement bei US-Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.

» Ein Long-Engagement bei US-amerikanischer und kanadischer Duration trug zur Rendite bei, da die Renditen auf US-amerikanische und kanadische Staatsanleihen zurückgingen.

» Ein Long-Engagement bei japanischen Aktien trug zur Rendite bei, da die Kurse stiegen.

» Ein Short-Engagement bei europäischen Aktien belastete die Wertentwicklung, da die Kurse stiegen.

» Ein Short-Engagement bei italienischer und französischer Duration belastete die Wertentwicklung, da die Renditen zurückgingen.

# Emerging Asia Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2010) | 8,77 % | 3,94 % |
| JPMorgan Asia Credit Index[2] | 8,04 % | 4,75 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jun. 2011) | 9,18 % | 4,40 % |
| JPMorgan Asia Credit Index (EUR Unhedged) | 8,45 % | 5,95 % |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2011) | 8,61 % | 2,01 % |
| JPMorgan Asia Credit Index (HKD Unhedged) | 7,69 % | 3,25 % |

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

2 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Emerging Asia Bond Fund repräsentiert: 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 1. Juni 2016: JPMorgan Asia Credit Index.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Asia Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds legt in einen Mix aus Renteninstrumenten (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Emittenten, die wirtschaftlich mit asiatischen Ländern mit Schwellenwertpapiermärkten, ausgenommen Japan, verbunden sind, Derivaten (wie im Verkaufsprospekt definiert) auf diese Wertpapiere sowie Schwellenmarktwährungen an. Vom Teilfonds gekaufte Rentenwerte (wie im Verkaufsprospekt definiert) sind von Moody's mindestens mit Caa oder von S&P mit CCC oder von 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Die Titelauswahl bei chinesischen ausländischen Unternehmensanleihen und Schuldtiteln quasi-staatlicher Emittenten trug zur relativen Wertentwicklung bei.

» Ein untergewichtetes Engagement bei südkoreanischen Auslandsschulden, die sich schwächer entwickelten als der Index, trug zur relativen Wertentwicklung bei.

» Ein übergewichtetes Engagement bei sri-lankischen Auslandsschulden während eines Teils des Berichtszeitraums schmälerte die relative Wertentwicklung.

» Ein übergewichtetes Engagement bei thailändischen Auslandsschulden schmälerte die relative Wertentwicklung.

# Emerging Local Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 11. Dez. 2007) | 10,71 % | 2,66 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2008) | 10,61 % | 2,40 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Aug. 2010) | 10,48 % | 0,37 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008) | 10,11 % | 4,12 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2010) | 10,15 % | 0,23 % |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008) | 11,10 % | 5,97 % |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) | 8,72 % | 3,14 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Okt. 2012) | 9,46 % | (0,42 %) |
| Investor CHF (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2011) | 9,27 % | 0,71 % |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (CHF Unhedged) | 7,53 % | 1,59 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged) thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010) | 11,19 % | 2,99 % |
| Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Jun. 2010) | 11,11 % | 2,20 % |
| Investor EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2011) | 10,97 % | 2,46 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009) | 10,56 % | 3,97 % |
| Class E EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | 10,57 % | 10,79 % |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged) | 9,14 % | 5,53 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008) | 10,75 % | 6,98 % |
| JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (GBP Unhedged) | 8,80 % | 7,46 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Emerging Local Bond Fund beabsichtigt, seine Erträge mithilfe umsichtiger Anlageverwaltung zu maximieren. Der Teilfonds 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Übergewichtete Engagements bei der lokalen peruanischen Duration trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen Renditen in Peru sanken.

» Ein nicht im Vergleichsindex enthaltenes Engagement im ägyptischen Pfund trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Währung dank einer Aufwertung gegenüber dem US-Dollar und hohem Carry eine positive Gesamtrendite erzielte.

» Ein nicht im Vergleichsindex enthaltenes Engagement bei der lokalen israelischen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die lokalen Renditen in Israel sanken.

» Ein untergewichtetes Engagement bei lokaler chilenischer Duration schmälerte die relative Wertentwicklung, da die lokalen Zinsen in Chile nachgaben.

» Ein untergewichtetes Engagement im thailändischen Baht schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.

# Emerging Markets Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jul. 2001) | 11,10 % | 9,39 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 13. Dez. 2001) | 11,09 % | 8,67 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2002) | 10,89 % | 7,87 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 29. Mai 2003) | 10,84 % | 6,70 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 10,60 % | 5,49 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005) | 10,61 % | 5,63 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 17. Okt. 2002) | 11,02 % | 8,99 % |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010) | 10,55 % | 4,49 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | 10,63 % | 4,37 % |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 18. Nov. 2008) | 11,48 % | 9,83 % |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global | 10,60 % | 8,52 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| M Retail AUD (Hedged) ausschüttend (Auflegung 19. Dez. 2012) | 10,02 % | 3,69 % |
| JPMorgan EMBI Global (AUD Hedged) | 10,00 % | 4,76 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2005) | 9,14 % | 4,60 % |
| JPMorgan EMBI Global (CHF Hedged) | 8,69 % | 4,87 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2002) | 9,38 % | 7,53 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Dez. 2010) | 9,46 % | 4,46 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Aug. 2009) | 9,17 % | 5,40 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 8,88 % | 4,41 % |
| JPMorgan EMBI Global (Euro Hedged) | 8,90 % | 7,43 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2018) | 11,58 % | 11,72 % |
| JPMorgan EMBI Global (EUR Unhedged) | 11,02 % | 11,68 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004) | 9,99 % | 7,05 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 9,99 % | 6,03 % |
| JPMorgan EMBI Global (GBP Hedged) | 9,46 % | 7,37 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2018) | 10,59 % | 10,70 % |
| Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007) | 10,16 % | 4,57 % |
| JPMorgan EMBI Global (SGD Hedged) | 10,16 % | 6,05 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Übergewichtete Engagements bei ukrainischen Staatsanleihen trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Ukraine die Wertentwicklung des Index übertraf.

» Ein nicht im Vergleichsindex enthaltenes Engagement bei ausgewählten Lokalwährungen von Schwellenländern, die eine positive Gesamtrendite erzielten, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.

» Ein Engagement bei brasilianischen Unternehmensanleihen, die die Wertentwicklung des Index übertrafen, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.

» Eine Untergewichtung der US-Duration auf Portfolioebene schmälerte die relative Wertentwicklung, da US-Zinsen sanken.

» Die Titelauswahl in Mexiko war der relativen Wertentwicklung abträglich.

# Emerging Markets Corporate Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Nov. 2009) | 9,38 % | 5,46 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 27. Feb. 2012) | 8,78 % | 3,65 % |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 03. Dez. 2009) | 9,85 % | 6,57 % |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) | 9,14 % | 6,60 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012) | 6,95 % | 2,04 % |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (CHF Hedged) | 7,29 % | 4,00 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Feb. 2010) | 7,68 % | 4,32 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mrz. 2010) | 7,17 % | 3,23 % |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (EUR Hedged) | 7,49 % | 5,39 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Jun. 2011) | 8,27 % | 3,91 % |
| JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (GBP Hedged) | 8,06 % | 5,16 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl in Nigeria trug zur relativen Wertentwicklung bei.

» Ein übergewichtetes Engagement bei ukrainischen Unternehmensanleihen, die die Wertentwicklung des Index übertrafen, trug zur relativen Wertentwicklung bei.

» Ein übergewichtetes Engagement bei südafrikanischen Unternehmensanleihen, die die Wertentwicklung des Index übertrafen, trug zur relativen Wertentwicklung bei. Die Titelauswahl in Südafrika lieferte ebenfalls einen positiven Beitrag zur relativen Wertentwicklung.

» Eine Untergewichtung der Spread-Duration von Unternehmensanleihen aus Schwellenländern auf Portfolioebene schmälerte die relative Wertentwicklung, da sich die Spreads auf Unternehmensanleihen aus Schwellenländern strafften.

» Eine Untergewichtung der US-Duration auf Portfolioebene schmälerte die relative Wertentwicklung, da US-Zinsen sanken.

# PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019) | — | 3,00 % |
| 50 % JPMorgan EMBI Global Index / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (USD Unhedged) | — | 3,62 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Jun. 2019) | — | 2,10 % |
| 50 % JPMorgan EMBI Global Index (EUR Hedged) / 50 % JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (EUR Unhedged) | — | 2,77 % |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Der Fonds hat die Geschäftstätigkeit am 4. Juni 2019 aufgenommen.

# Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Sep. 2006) | 4,83 % | 2,61 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 19. Nov. 2008) | 4,29 % | 2,00 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Okt. 2006) | 4,36 % | 1,54 % |
| JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) | 3,57 % | 2,63 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2010) | 5,24 % | 3,36 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Jul. 2009) | 4,78 % | 2,95 % |
| JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (EUR Unhedged) | 3,97 % | 3,88 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein nicht im Vergleichsindex enthaltenes Engagement im ägyptischen Pfund trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Währung dank einer Aufwertung gegenüber dem US-Dollar und hohem Carry eine positive Gesamtrendite erzielte.

» Ein nicht im Vergleichsindex enthaltenes Engagement im nigerianischen Naira trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Währung dank hohem Carry eine positive Gesamtrendite erzielte.

» Ein übergewichtetes Engagement im peruanischen Peso und ein Engagement bei der lokalen peruanischen Duration trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Währung gegenüber dem US-Dollar aufgewertet wurde und die lokalen Renditen in Peru sanken.

» Ein gegen Ende des zweiten Quartals eingerichtetes untergewichtetes Engagement im südkoreanischen Won schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.

» Ein gegen Ende des zweiten Quartals eingerichtetes untergewichtetes Engagement im chilenischen Peso schmälerte die relative Wertentwicklung, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.

# Euro Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998) | 5,97 % | 4,72 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Jan. 2003) | 5,97 % | 4,62 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2002) | 5,75 % | 4,57 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2002) | 5,75 % | 4,54 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2001) | 5,68 % | 4,40 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 5,50 % | 3,52 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005) | 5,49 % | 3,18 % |
| FTSE Euro Broad Investment-Grade Index | 5,41 % | 4,46 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2006) | 5,72 % | 3,62 % |
| FTSE Euro Broad Investment-Grade (CHF Hedged) Index | 5,16 % | 3,62 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein übergewichtetes Engagement bei US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein Engagement bei nachrangigen Schuldtiteln aus dem Finanzsektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein übergewichtetes Engagement bei deutscher Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein untergewichtetes Engagement bei italienischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Ein untergewichtetes Engagement bei französischer und niederländischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

# Euro Credit Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2008) | 5,48 % | 4,63 % |
| Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 01. Okt. 2013) | 5,41 % | 4,09 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2010) | 4,94 % | 3,44 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019) | — | 0,80 % |
| H Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 07. Jun. 2019) | — | 0,80 % |
| Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index | 5,39 % | 4,36 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Bankensektor wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da ausgewählte Emittenten vorraniger finanzieller Schuldtitel im Berichtszeitraum stiegen.

» Ein übergewichtetes Engagement im Immobiliensektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Ein übergewichtetes Engagement bei der dänischen Duration wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Zinssätze im Berichtszeitraum stiegen.

» Ein übergewichtetes Engagement bei staatlichen Wertpapieren war der Wertentwicklung abträglich, da sich der Sektor im Berichtszeitraum unterdurchschnittlich entwickelte.

» Ein untergewichtetes Engagement im Versorgungssektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, war der Wertentwicklung abträglich.

# Euro Income Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011) | 4,97 % | 5,15 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011) | 4,93 % | 5,16 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 29. Mai 2012) | 4,78 % | 5,08 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2011) | 4,52 % | 4,21 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2011) | 4,50 % | 4,21 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 4,36 % | 2,05 % |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 4,28 % | 2,04 % |
| Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index | 3,30 % | 3,58 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein Engagement bei US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein Engagement bei europäischer Duration mit Fokus auf die Kernländer trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein breit gefächertes Engagement bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Das Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein Engagement bei Agency-MBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich der Sektor schwächer entwickelte als Treasuries.

» Ein taktisches Long-Engagement bei der türkischen Lira belastete die Wertentwicklung, da die Währung während des Berichtszeitraums gegenüber dem Euro abgewertet wurde.

# Euro Long Average Duration Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Apr. 2006) | 14,55 % | 8,37 % |
| Bloomberg Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index[2] | 13,48 % | 7,10 % |

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

[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Long Average Duration Fund repräsentiert Folgendes: 21. April 2006 bis 31. März 2011 — (Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond > 15 Years Index); 31. März 2011 bis 31. Januar 2012 — (Citigroup Euro Broad Investment-Grade (EuroBIG) Bond AAA rated > 15 Years Index); seit dem 31. Januar 2012 — (Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index).*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die in allen Kreditsektoren verzeichnete Verengung der Spreads verstärkte die relative Wertentwicklung. Bei Unternehmensanleihen war die Outperformance vor allem auf Finanz- und Industriewerte zurückzuführen. Allokationen auf supranationale Titel leisteten ebenfalls einen positiven Beitrag, da sich die Spreads auf quasi-staatliche Titel verengten.

» Auf US-amerikanische und dänische Duration ausgerichtete Strategien leisteten einen positiven Beitrag, da Long-Zins-Positionen im Zuge sinkender Zinssätze stark zulegten. Auf die Duration und Zinsstrukturkurve der Eurozone ausgerichtete Strategien schmälerten die Wertentwicklung. Die Verluste waren jedoch nicht so hoch, dass sie die insgesamt erzielte Outperformance der Durations- und Zinskurvenstrategie ausgeglichen hätten.

» Ein Engagement bei einem Korb von Schwellenmarktwährungen mit hohem Carry leistete einen positiven Beitrag zur Outperformance, da eine Auswahl dieser Währungen gegenüber den Finanzierungswährungen aufgewertet wurde.

# Euro Low Duration Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Jul. 2011) | 1,06 % | 1,72 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Mrz. 2013) | 0,60 % | 0,02 % |
| Bloomberg Barclays Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index[3] | 0,79 % | 1,57 %[2] |

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Euro Low Duration Fund repräsentiert Folgendes: 05. Juli 2011 bis 30. September 2012 — (PIMCO European Advantage Government 1-3 Year Bond Index); 30. September 2012 — (Barcap Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index). Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird seit dem 30. Juni 2011 berechnet.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Euro Low Duration Fund möchte die bei Kapitalerhalt und umsichtiger Vermögensverwaltung maximal mögliche Gesamtrendite erzielen. Der Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus auf Euro lautenden Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten anlegt. Die durchschnittliche Portfolio-Duration des Teilfonds liegt grundsätzlich innerhalb eines Bereichs von etwa zwei Jahren über oder unter der Duration des Bloomberg Barclays Euro Aggregate ex-Treasury 1-3 Year Index.

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein übergewichtetes Engagement bei der Duration europäischer Kernländer trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein Engagement beim russischen Rubel war der Wertentwicklung zuträglich, da dieser gegenüber dem Euro an Wert gewann.

» Ein Engagement bei verbrieften Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein untergewichtetes Engagement bei französischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Ein untergewichtetes Engagement bei gedeckten Anleihen schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

# Euro Short-Term Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2006) | 0,25 % | 1,42 % |
| Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 06. Mai 2016) | 0,26 % | (0,45 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | (0,09 %) | 0,66 % |
| 1 Month Euribor Index | (0,18 %) | 0,98 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein Engagement bei verbrieften Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein Engagement bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein Engagement in Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein Engagement in negativen Euro-Barzinsen belastete die Wertentwicklung.

# Global Advantage Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 09. Jun. 2009) | 6,22 % | 3,53 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2010) | 5,64 % | 1,38 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) | 5,84 % | 3,11 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Aug. 2011) | 4,90 % | 2,67 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (CHF, Partially Hedged) (London Close) | 4,54 % | 2,26 % |
| **Auf DKK lautende Klassen** | | |
| Institutional DKK (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Mrz. 2013) | 5,29 % | 2,04 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (DKK, Partially Hedged) (London Close) | 4,95 % | 1,60 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Mai 2010) | 5,42 % | 3,28 % |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mai 2010) | 4,87 % | 2,26 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (EUR, Partially Hedged) (London Close) | 5,04 % | 2,95 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jul. 2012) | 5,79 % | 3,37 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (GBP, Partially Hedged) (London Close) | 5,50 % | 3,06 % |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Mrz. 2012) | 5,59 % | 4,69 % |
| PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (NOK, Partially Hedged) (London Close) | 5,23 % | 4,35 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein übergewichtetes Engagement bei US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein übergewichtetes Engagement bei lokaler Duration der Schwellenländer trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein übergewichtetes Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen war der Wertentwicklung zuträglich, da sich die Spreads verengten.

» Ein untergewichtetes Engagement bei französischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Ein untergewichtetes Engagement bei italienischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Ein untergewichtetes Engagement bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads verengten.

» Ein übergewichtetes Engagement bei Agency-MBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

# Global Advantage Real Return Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jul. 2011) | 7,69 % | (0,25 %) |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012) | 7,16 % | (2,15 %) |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 08. Nov. 2012) | 8,03 % | (0,32 %) |
| PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged) | 7,49 % | 0,35 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 27. Mrz. 2012) | 6,31 % | 0,59 % |
| PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (CHF Partial Hedged) | 6,24 % | 1,14 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jul. 2011) | 7,19 % | 1,76 % |
| Institutional EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Mrz. 2013) | 7,14 % | 0,05 % |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Dez. 2012) | 6,65 % | (0,59 %) |
| G Institutional EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 7,17 % | 2,10 % |
| PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (EUR Partial Hedged) | 7,06 % | 2,37 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2012) | 7,38 % | 2,01 % |
| PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (GBP Partial Hedged) | 7,29 % | 2,62 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Advantage Real Return Fund versucht, bei gleichzeitigem Kapitalerhalt und umsichtiger Anlageverwaltung eine höchstmögliche reale Rendite zu erzielen, indem er mindestens 70 % seines Nettovermögens in internationale, inflationsindexierte Rentenwerte in Landeswährung aus Industrie- und Schwellenmärkten anlegt (wie im Verkaufsprospekt definiert).

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein übergewichtetes Engagement bei der realen US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Realrenditen zurückgingen.

» Ein übergewichtetes Engagement bei der brasilianischen nominalen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Nominalrenditen zurückgingen.

» Ein Engagement bei verbrieften Produkten trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Eine Untergewichtung der nominalen US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die US-Nominalrenditen sanken.

» Eine Untergewichtung der brasilianischen Realduration schmälerte die Wertentwicklung, da die brasilianischen Realrenditen nachgaben.

# Global Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Mrz. 1998) | 6,25 % | 5,76 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2001) | 6,26 % | 5,51 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 01. Mrz. 1999) | 6,03 % | 5,26 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001) | 6,02 % | 5,14 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Jun. 2004) | 5,99 % | 4,98 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 5,75 % | 4,57 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005) | 5,81 % | 4,49 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002) | 6,15 % | 5,23 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017) | 5,86 % | 3,76 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 6,14 % | 3,82 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 5,67 % | 3,11 % |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 5,54 % | 3,10 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index[3] | 6,00 % | 4,98 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional USD (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2002) | 5,78 % | 5,12 % |
| Institutional USD (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 23. März 2006) | 5,76 % | 4,89 % |
| Investor USD (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 31. März 2005) | 5,62 % | 3,99 % |
| Class E USD (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 19. Mai 2010) | 5,31 % | 3,16 % |
| Class E USD (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2010) | 5,36 % | 3,15 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Unhedged) Index | 5,57 % | 4,21 %[2] |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2018) | 5,78 % | 6,20 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (CAD Hedged) Index | 5,48 % | 7,12 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2003) | 4,39 % | 3,47 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Apr. 2003) | 4,41 % | 3,52 % |
| Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Jun. 2011) | 4,23 % | 3,38 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 13. Jun. 2018) | 3,94 % | 2,77 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (CHF Hedged) Index | 4,13 % | 2,59 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2003) | 4,62 % | 4,56 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Apr. 2005) | 4,64 % | 4,54 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2017) | 4,63 % | 1,62 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Feb. 2005) | 4,46 % | 4,16 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2016) | 4,37 % | 1,63 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 4,18 % | 3,85 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | 4,22 % | 1,61 % |
| G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2012) | 4,12 % | 1,88 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 4,53 % | 2,51 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 3,98 % | 1,44 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Hedged) Index | 4,39 % | 3,60 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013) | 6,19 % | 4,69 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Unhedged) Index | 5,97 % | 4,21 % |

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein übergewichtetes Engagement bei US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein Engagement bei nachrangigen Schuldtiteln aus dem Finanzsektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein Engagement bei einem Korb von Schwellenmarktwährungen mit hohem Carry war der Wertentwicklung zuträglich, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar aufgewertet wurden.

» Ein untergewichtetes Engagement bei italienischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Ein untergewichtetes Engagement bei französischer und niederländischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Ein übergewichtetes Engagement bei Agency-MBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2003) | 5,24 % | 5,54 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Jun. 2004) | 5,28 % | 5,64 % |
| Investor GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Apr. 2005) | 5,04 % | 5,00 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Nov. 2009) | 4,84 % | 4,53 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 5,11 % | 3,32 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Hedged) Index | 5,05 % | 4,65 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional GBP (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 09. Mrz. 2018) | 5,85 % | 9,11 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Unhedged) Index | 5,64 % | 9,81 % |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend II (Auflegung: 26. Apr. 2017) | 5,52 % | 3,90 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (HKD Unhedged) Index | 5,34 % | 4,27 % |
| **Auf ILS lautende Klassen** | | |
| Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2010) | 5,04 % | 5,16 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (ILS Hedged) Index | 4,69 % | 3,86 % |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005) | 5,39 % | 5,73 % |
| Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Jul. 2006) | 5,21 % | 5,91 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (NOK Hedged) Index | 5,15 % | 4,70 %[2] |
| **Auf NZD lautende Klassen** | | |
| Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Nov. 2004) | 5,81 % | 7,98 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (NZD Hedged) Index | 5,57 % | 6,96 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Nov. 2004) | 4,73 % | 4,80 % |
| Class R SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018) | 4,58 % | 4,21 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (SEK Hedged) Index | 4,49 % | 3,74 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Aug. 2009) | 5,89 % | 6,11 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (SGD Hedged) Index | 5,65 % | 4,21 % |

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

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

[3] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Fund repräsentiert Folgendes: 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.*

# Global Bond ESG Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | 6,33 % | 4,25 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Nov. 2018) | 6,16 % | 6,90 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 07. Mrz. 2019) | — | 3,90 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019) | — | 3,93 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019) | — | 3,69 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index | 6,00 % | 4,32 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | 6,06 % | 4,78 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Index (AUD Hedged) | 5,55 % | 4,34 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | 4,46 % | 1,25 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (CHF Hedged) Index | 4,13 % | 1,25 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | 4,72 % | 1,68 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | 4,67 % | 1,66 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 09. Feb. 2017) | 4,29 % | 0,92 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (EUR Hedged) Index | 4,39 % | 1,73 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | 5,31 % | 2,74 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (GBP Hedged) Index | 5,05 % | 2,81 % |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Jan. 2017) | 5,58 % | 3,10 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (NOK Hedged) Index | 5,15 % | 3,14 % |
| **Auf NZD lautende Klassen** | | |
| Institutional NZD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 05. Apr. 2017) | 5,91 % | 4,34 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (NZD Hedged) Index | 5,57 % | 4,64 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Global Bond ESG Fund 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Eine Übergewichtung von US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein Engagement bei einem Korb von Schwellenmarktwährungen mit hohem Carry war der Wertentwicklung zuträglich, da diese Währungen gegenüber dem US-Dollar aufgewertet wurden.

» Ein übergewichtetes Engagement bei Finanzwerten mit Investment Grade und ein Engagement in nachrangigen Finanzwerten trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Eine Untergewichtung italienischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Eine Untergewichtung japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Eine Übergewichtung von Agency-MBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich die Spreads erweiterten.

# Global Bond Ex-US Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2003) | 5,92 % | 5,39 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 09. Nov. 2005) | 5,94 % | 5,66 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2006) | 5,72 % | 5,26 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 14. Sep. 2004) | 5,68 % | 5,16 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008) | 5,49 % | 5,07 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | 5,88 % | 6,20 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index[3] | 5,79 % | 4,35 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Class E USD (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 04. Okt. 2016) | 4,66 % | 0,81 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Unhedged) Index | 4,99 % | 1,11 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Apr. 2006) | 4,35 % | 5,15 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index[4] | 4,17 % | 3,81 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Feb. 2019) | — | 3,36 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (GBP Hedged) | — | 3,66 % |

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

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

3 *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.*

4 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global Bond Ex-US Fund repräsentiert: Von der Auflegung bis zum 19. Januar 2016: FTSE World Government Bond Ex-U.S. Index (EUR Hedged). Seit dem 20. Januar 2016: Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (EUR Hedged) Index.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein übergewichtetes Engagement bei der Duration der Eurozone trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein übergewichtetes Engagement bei US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein Engagement bei nachrangigen Schuldtiteln aus dem Finanzsektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein untergewichtetes Engagement bei italienischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Ein untergewichtetes Engagement bei französischer und niederländischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Ein untergewichtetes Engagement bei japanischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

# Global High Yield Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005) | 10,46 % | 6,93 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 10,53 % | 6,99 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2016) | 10,24 % | 6,69 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 27. Jun. 2008) | 10,15 % | 6,77 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 11. Dez. 2015) | 10,14 % | 7,33 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006) | 10,00 % | 5,97 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006) | 9,97 % | 6,05 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008) | 10,37 % | 7,31 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2013) | 10,36 % | 5,19 % |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2010) | 10,01 % | 5,72 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | 9,88 % | 4,43 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 10,28 % | 5,43 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 9,72 % | 4,50 % |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 9,70 % | 4,47 % |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD[3] | 10,19 % | 7,21 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Feb. 2010) | 8,66 % | 5,79 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Aug. 2012) | 8,66 % | 4,28 % |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into CHF[3] | 8,31 % | 6,05 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Mai 2008) | 8,74 % | 6,04 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 8,81 % | 6,08 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Jan. 2011) | 8,56 % | 4,95 % |
| Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Aug. 2010) | 8,41 % | 5,23 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 8,28 % | 5,04 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Apr. 2016) | 8,30 % | 3,65 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2016) | 8,14 % | 2,28 % |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into EUR[3] | 8,47 % | 6,10 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2012) | 9,34 % | 5,98 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 9,31 % | 6,78 % |
| Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 21. Jul. 2010) | 9,01 % | 5,95 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009) | 8,75 % | 7,40 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 9,16 % | 4,80 % |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into GBP[3] | 8,98 % | 6,82 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2016) | 9,55 % | 5,73 % |
| ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into SGD[3] | 9,74 % | 6,95 % |

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

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

3 *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Global High Yield Fund repräsentiert Folgendes: Seit Auflegung bis zum 31. März 2014 — (ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield, BB-B Rated, Constrained Index); seit dem 1. 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 Teilfonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er mindestens zwei Drittel seines Gesamtnettovermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus hoch verzinslichen Rentenpapieren (wie im Verkaufsprospekt definiert) anlegt, die 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Die Titelauswahl im Kabel-/Pay-TV-Sektor trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Kabel-/Pay-TV-Sektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.

» Die Titelauswahl im Metall- und Bergbausektor trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Metall- und Bergbausektor 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.

» Ein untergewichtetes Engagement im Finanz- und Versicherungssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.

» Ein untergewichtetes Engagement im Telekommunikationssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.

» Ein untergewichtetes Engagement im Ausrüstungssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.

# Global Investment Grade Credit Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Apr. 2008) | 8,70 % | 6,17 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jul. 2003) | 8,70 % | 5,83 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2005) | 8,55 % | 5,29 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009) | 8,49 % | 6,81 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 21. Jan. 2009) | 8,41 % | 6,64 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 21. Jan. 2009) | 8,40 % | 6,64 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2008) | 8,23 % | 6,47 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2008) | 8,22 % | 5,15 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Aug. 2008) | 8,61 % | 6,25 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018) | 8,59 % | 8,29 % |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 28. Sep. 2012) | 8,23 % | 3,65 % |
| M Retail, ausschüttend II (Auflegung: 23. Dez. 2013) | 8,22 % | 4,39 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 8,57 % | 4,13 % |
| Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 8,60 % | 4,15 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 8,00 % | 3,49 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) | 8,22 % | 4,75 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional USD (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2013) | 8,28 % | 3,73 % |
| Institutional USD (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 06. Sep. 2016) | 8,27 % | 3,51 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Unhedged) | 7,75 % | 3,10 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Investor AUD (Hedged), ausschüttende Anteile (Auflegung: 25. Juni 2018) | 7,99 % | 8,49 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (AUD Hedged) | 7,74 % | 8,78 % |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Investor CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018) | 7,89 % | 8,06 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (CAD Hedged) | 7,64 % | 8,39 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Dez. 2009) | 6,79 % | 4,36 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 06. Feb. 2015) | 6,88 % | 2,12 % |
| Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Mai 2011) | 6,59 % | 3,22 % |
| Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009) | 6,61 % | 5,39 % |
| Administrative CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 2013) | 6,61 % | 2,13 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Mrz. 2012) | 6,39 % | 2,51 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged) | 6,32 % | 4,39 %[2] |
| **Auf CNH lautende Klassen** | | |
| Investor RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jun. 2018) | 8,53 % | 9,94 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (CNH Hedged) | 8,18 % | 10,02 % |
| **Auf CZK lautende Klassen** | | |
| Institutional CZK (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Mai 2015) | 8,12 % | 2,91 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (CZK Hedged) | 7,67 % | 2,46 % |

## 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Ein übergewichtetes Engagement im Bankensektor und insbesondere bei nachrangigen Finanztiteln, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, trug zur Wertentwicklung bei.

» Ein übergewichtetes Engagement in Schwellenländern, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Ein übergewichtetes Engagement bei Immobilienfonds, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Ein untergewichtetes Engagement bei US-Duration belastete die Wertentwicklung, da die Zinsen sanken.

» Ein untergewichtetes Engagement im Versorgungssektor und insbesondere bei längerfristigen Anleihen, die sich überdurchschnittlich entwickelten, schmälerte die Wertentwicklung.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2003) | 7,05 % | 5,12 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2008) | 7,04 % | 5,79 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 08. Mai 2006) | 6,85 % | 4,87 % |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009) | 6,87 % | 6,00 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Feb. 2009) | 6,79 % | 5,70 % |
| Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Feb. 2009) | 6,81 % | 5,69 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 6,62 % | 4,22 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Sep. 2010) | 6,50 % | 3,40 % |
| Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 6,87 % | 2,77 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 6,45 % | 1,81 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged) | 6,57 % | 3,99 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional EUR (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 16. Aug. 2012) | 8,67 % | 4,51 % |
| Class E EUR (Currency Exposure), ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | 8,25 % | 8,36 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (EUR Unhedged) | 8,16 % | 4,27 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Sep. 2005) | 7,69 % | 5,57 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Jul. 2008) | 7,67 % | 6,24 % |
| Investor GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jan. 2009) | 7,51 % | 6,52 % |
| Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jan. 2009) | 7,46 % | 6,32 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mrz. 2009) | 7,23 % | 6,08 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 7,54 % | 3,60 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged) | 7,22 % | 4,59 %[2] |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017) | 8,27 % | 4,44 % |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Jul. 2017) | 7,97 % | 3,96 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (HKD Unhedged) Credit Index | 7,52 % | 3,33 % |
| **Auf HUF lautende Klassen** | | |
| Institutional HUF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2015) | 7,28 % | 3,09 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (HUF Hedged) | 6,81 % | 2,55 % |
| **Auf ILS lautende Klassen** | | |
| Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2010) | 7,41 % | 5,34 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (ILS Hedged) | 6,85 % | 4,66 % |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Jan. 2012) | 7,84 % | 5,64 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (NOK Hedged) | 7,33 % | 4,90 % |
| **Auf PLN lautende Klassen** | | |
| Institutional PLN (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 10. Jun. 2015) | 8,06 % | 5,29 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (PLN Hedged) | 7,64 % | 4,80 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 04. Dez. 2009) | 7,19 % | 5,40 % |
| Administrative SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Dez. 2012) | 6,92 % | 2,69 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (SEK Hedged) | 6,70 % | 4,46 %[2] |

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | 8,33 % | 5,38 % |
| Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018) | 8,00 % | 7,54 % |
| Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Sept. 2017) | 8,05 % | 3,54 % |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Jul. 2012) | 7,85 % | 3,73 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (SGD Hedged) | 7,84 % | 4,08 %[2] |

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

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

# Global Investment Grade Credit ESG Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018) | 8,98 % | 9,20 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 26. Jun. 2019) | — | 0,40 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged) | 8,22 % | 8,60 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018) | 7,16 % | 6,30 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (CHF Hedged) | 6,32 % | 5,68 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018) | 7,34 % | 6,70 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (EUR Hedged) | 6,57 % | 6,05 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2018) | 8,02 % | 7,70 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mai 2019) | — | 2,78 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (GBP Hedged) | 7,22 % | 7,07 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Bankensektor wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich ausgewählte Emittenten im Berichtszeitraum überdurchschnittlich entwickelten.

» Ein übergewichtetes Engagement bei der USD-Duration wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Zinssätze im Berichtszeitraum stiegen.

» Ein übergewichtetes Engagement im Immobiliensektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Ein untergewichtetes Engagement in den Schwellenmarktsektoren war der Wertentwicklung abträglich, da die Spreads im Berichtszeitraum zunahmen.

» Ein untergewichtetes Engagement im Energiesektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, war der Wertentwicklung abträglich.

# Global Libor Plus Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | 3,87 % | 3,53 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2019) | — | 2,13 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2018) | 3,57 % | 3,02 % |
| 1 Month USD LIBOR Index | 1,25 % | 1,39 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | 2,15 % | 1,24 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Apr. 2018) | 2,19 % | 0,97 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2018) | 2,04 % | 0,14 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017) | 1,96 % | (0,65 %) |
| 1 Month Euribor Index | (0,18 %) | (0,36 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | 2,85 % | 2,30 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2019) | — | 2,10 % |
| 1 Month GBP-LIBOR-Index | 0,37 % | 0,48 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein Long-Engagement bei US-Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein Long-Engagement bei Schuldtiteln mit Investment Grade trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein Long-Engagement bei hochverzinslichen Schuldtiteln trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein Long-Engagement beim russischen Rubel war der Wertentwicklung zuträglich, da die Währung gegenüber dem US-Dollar an Wert gewann.

» Ein Short-Engagement bei britischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

» Ein Short-Engagement bei italienischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Renditen nachgaben.

# Global Low Duration Real Return Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 3,86 % | 1,38 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Mrz. 2018) | 3,87 % | 3,17 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 05. Okt. 2016) | 3,74 % | 1,98 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 3,33 % | 0,46 % |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged) | 3,27 % | 1,45 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 2,01 % | (0,64 %) |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (CHF Hedged) | 1,48 % | (0,66 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 2,27 % | (0,17 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 17. Jan. 2017) | 2,19 % | (0,32 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Dez. 2014) | 2,27 % | (0,18 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 1,72 % | (1,07 %) |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (EUR Hedged) | 1,68 % | (0,10 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017) | 2,83 % | 0,73 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 2,91 % | 0,69 % |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (GBP Hedged) | 2,30 % | 0,76 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Eine Übergewichtung der realen US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Realrenditen zurückgingen.

» Eine Übergewichtung der deutschen nominalen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die deutschen Nominalrenditen zurückgingen.

» Ein Engagement bei verbrieften Produkten trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Eine Untergewichtung der nominalen US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die US-Nominalrenditen sanken.

» Eine Untergewichtung der französischen nominalen Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die französischen Nominalrenditen sanken.

# Global Multi-Asset Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009) | 10,01 % | 5,82 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2010) | 9,86 % | 3,37 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 22. Jun. 2009) | 9,34 % | 4,24 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Jan. 2011) | 9,35 % | 2,15 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 06. Jul. 2016) | 10,59 % | 8,77 % |
| 60 % MSCI All Country World Index/40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged | 12,22 % | 8,69 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Apr. 2009) | 8,35 % | 5,10 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Jul. 2010) | 8,30 % | 3,50 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 22. Jun. 2009) | 7,75 % | 3,52 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Jun. 2011) | 7,65 % | 1,26 % |
| 60 % MSCI All Country World Index EUR Hedged /40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate EUR Hedged | 10,52 % | 7,69 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Apr. 2010) | 8,81 % | 3,80 % |
| 60 % MSCI All Country World Index GBP Hedged /40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate GBP Hedged | 10,94 % | 6,53 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein übergewichtetes Engagement bei der US-Durationpositionierung trug zur Wertentwicklung bei, da die Renditen zurückgingen.

» Ein übergewichtetes Engagement bei auf Lokalwährungen lautenden Schwellenmarktanleihen trug zur relativen Wertentwicklung bei.

» Ein übergewichtetes Engagement bei auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen aus Schwellenländern trug zur relativen Wertentwicklung bei.

» Ein untergewichtetes Engagement bei Aktien aus der Eurozone schmälerte die Wertentwicklung, da diese positive Renditen verbuchten.

» Die Positionierung bei US-Aktien schmälerte die relative Wertentwicklung.

» Die Positionierung bei Aktien aus Schwellenländern schmälerte die relative Wertentwicklung.

# Global Real Return Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003) | 7,34 % | 5,07 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 7,37 % | 4,76 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 04. Mrz. 2004) | 7,18 % | 4,52 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009) | 7,18 % | 5,59 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 17. Dez. 2004) | 7,14 % | 4,28 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 6,87 % | 4,04 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005) | 6,90 % | 3,88 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 21. Mai 2004) | 7,27 % | 4,90 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 7,19 % | 2,91 % |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index | 6,30 % | 2,28 %[2] |
| **Auf USD lautende Klassen (Währungsrisiko)** | | |
| Institutional USD (Currency Exposure), thesaurierend (Auflegung: 01. Sep. 2017) | 6,78 % | 2,17 % |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Unhedged Index | 6,95 % | 4,91 % |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mrz. 2014) | 7,21 % | 6,31 % |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond AUD Hedged Index | 6,51 % | 5,97 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2008) | 5,45 % | 3,28 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | 5,44 % | 2,55 % |
| Investor CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009) | 5,27 % | 4,14 % |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond CHF Hedged Index | 5,08 % | 3,00 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003) | 5,71 % | 4,31 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 5,77 % | 3,92 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Apr. 2004) | 5,61 % | 3,85 % |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 24. Feb. 2009) | 5,62 % | 4,74 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 5,31 % | 3,24 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 5,53 % | 1,54 % |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond EUR Hedged Index | 5,36 % | 4,08 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 05. Feb. 2004) | 6,40 % | 5,30 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 27. Apr. 2005) | 6,39 % | 4,83 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Jun. 2009) | 5,97 % | 4,35 % |
| Class R GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 6,27 % | 2,40 % |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond GBP Hedged Index | 6,06 % | 5,14 %[2] |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Institutional SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2017) | 5,82 % | 2,52 % |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond SEK Hedged Index | 5,45 % | 2,74 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Feb. 2008) | 6,98 % | 4,29 % |
| Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond SGD Hedged Index | 6,61 % | 4,22 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein übergewichtetes Engagement bei der realen US-Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die Realrenditen zurückgingen.

» Ein Engagement bei verbrieften Produkten trug zur absoluten Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Eine Übergewichtung der deutschen nominalen Duration trug zur Wertentwicklung bei, da die deutschen Nominalrenditen zurückgingen.

» Eine Untergewichtung der nominalen US-Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die US-Nominalrenditen sanken.

» Eine Untergewichtung der französischen nominalen Duration beeinträchtigte die Wertentwicklung, da die französischen Nominalrenditen sanken.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 6,49 % | 6,62 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 6,44 % | 6,63 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2015) | 6,36 % | 5,25 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 18. Apr. 2013) | 6,30 % | 5,01 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 13. Feb. 2017) | 6,27 % | 4,81 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 6,20 % | 6,10 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 6,04 % | 5,69 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 5,99 % | 5,67 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Mai 2018) | 6,44 % | 6,71 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018) | 6,34 % | 6,66 % |
| Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Apr. 2015) | 6,38 % | 5,06 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 5,83 % | 3,92 % |
| Class T, ausschüttend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 5,83 % | 3,92 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 6,76 % | 7,20 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate Index | 6,11 % | 2,49 %[2] |
| **Auf AUD lautende Klassen** | | |
| Institutional AUD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Jan. 2018) | 6,10 % | 4,17 % |
| Investor AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018) | 5,83 % | 6,16 % |
| Administrative AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016) | 5,86 % | 5,69 % |
| Class E AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Feb. 2017) | 5,70 % | 4,43 % |
| Class Z AUD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2015) | 6,35 % | 6,86 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (AUD Hedged) Index | 5,66 % | 3,53 %[2] |
| **Auf BRL lautende Klassen** | | |
| Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Feb. 2016) | 9,03 % | 14,40 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate (BRL Hedged) Index | 7,35 % | 10,82 % |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Apr. 2016) | 6,00 % | 5,80 % |
| Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Sep. 2018) | 5,86 % | 6,84 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate Index (CAD Hedged) | 5,59 % | 2,25 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Dez. 2014) | 4,62 % | 3,21 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | 4,72 % | 3,10 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 4,19 % | 2,54 % |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 18. Feb. 2014) | 4,27 % | 2,55 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (CHF Hedged) Index | 4,24 % | 0,97 %[2] |
| **Auf CNH lautende Klassen** | | |
| Investor RMB (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2018) | 6,32 % | 5,20 % |
| Class E RMB (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mai 2013) | 6,03 % | 6,62 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (CNH Hedged) Index | 6,11 % | 5,44 %[2] |

## 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 Teilfonds investiert mindestens zwei Drittel seines Vermögens in ein diversifiziertes Portfolio aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) mit unterschiedlichen Laufzeiten. Der Teilfonds strebt hohe Dividendenerträge an, indem er in eine breite Palette von Rentenwertsektoren anlegt, die nach Ansicht der Anlageberatungsgesellschaft typischerweise Erträge auf erhöhtem Niveau einbringen.

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein Engagement in US-Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze aufwärts tendierten.

» Das Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein Engagement in US-Barzinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die kurzfristigen Zinsen weiterhin positiv sind.

» Eine Absicherungsposition gegenüber japanischer Duration belastete die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.

» Ein Short-Engagement bei britischer Duration belastete die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 4,94 % | 5,28 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 4,92 % | 5,26 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 29. Jul. 2014) | 4,92 % | 3,47 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2015) | 4,74 % | 2,87 % |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mai 2015) | 4,68 % | 3,03 % |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend A (Auflegung: 16. Dez. 2015) | 4,60 % | 3,61 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Aug. 2015) | 4,65 % | 3,11 % |
| Administrative EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Jun. 2016) | 4,68 % | 3,06 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 4,42 % | 4,33 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 4,40 % | 4,33 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 31. Aug. 2018) | 4,46 % | 4,01 % |
| G Retail EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Aug. 2017) | 4,47 % | 0,59 % |
| G Retail EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Mrz. 2019) | — | 1,70 % |
| H Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jun. 2017) | 4,87 % | 1,67 % |
| Class R EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | 4,75 % | 3,87 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 4,24 % | 2,16 % |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 4,20 % | 2,17 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (EUR Hedged) Index | 4,50 % | 1,18 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 07. Feb. 2019) | — | 3,50 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Feb. 2013) | 5,39 % | 4,87 % |
| Administrative GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Sept. 2016) | 5,17 % | 3,57 % |
| Class E GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 15. Mrz. 2017) | 5,03 % | 2,70 % |
| Class R GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 5,34 % | 5,77 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (GBP Hedged) Index | 5,18 % | 2,01 %[2] |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Institutional HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2015) | 6,34 % | 6,05 % |
| Administrative HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 26. Apr. 2017) | 6,00 % | 4,58 % |
| Class E HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 04. Feb. 2013) | 5,79 % | 4,68 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (HKD Unhedged) Index | 5,88 % | 2,80 %[2] |
| **Auf JPY lautende Klassen** | | |
| Institutional JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sep. 2017) | 5,10 % | 1,68 % |
| Class E JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 01. Sept. 2017) | 4,54 % | 0,76 % |
| Bloomberg Barclays U.S. Aggregate (JPY Hedged) Index | 4,48 % | 0,70 % |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Apr. 2017) | 5,64 % | 3,66 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (NOK Hedged) Index | 5,27 % | 2,19 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Dez. 2015) | 6,07 % | 6,01 % |
| Investor SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 23. Mai 2018) | 5,95 % | 5,98 % |
| Administrative SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 5,83 % | 6,04 % |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 19. Feb. 2013) | 5,56 % | 4,49 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (SGD Hedged) Index | 5,76 % | 2,47 %[2] |

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

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

# Inflation Strategy Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013) | 10,71 % | 0,05 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 14. Feb. 2013) | 10,07 % | (1,15 %) |
| 45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1-30 Year Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return[2] | 9,63 % | 0,21 % |
| OECD CPI + 3% (3 Month Lag)[3] | 2,07 % | 4,65 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 23. Mai 2013) | 9,50 % | (0,33 %) |
| Class E EUR (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2013) | 8,81 % | (1,65 %) |
| Class E EUR (Partially Hedged), ausschüttend (Auflegung: 16. Apr. 2013) | 8,86 % | (1,64 %) |
| 45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1-30 Year Index (EUR Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government ILB Index (EUR Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (EUR Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return[2] | 8,47 % | (0,26 %)[4] |
| OECD CPI + 3% (3 Month Lag)[3] | 2,07 % | 4,68 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Partially Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Mai 2014) | 9,75 % | 1,11 % |
| 45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1-30 Year Index (GBP Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government ILB Index (GBP Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (GBP Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return[2] | 8,76 % | 1,08 % |
| OECD CPI + 3% (3 Month Lag)[3] | 2,07 % | 4,76 % |

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

[2] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Inflation Strategy Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis 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 1. April 2017: 45 % BBG Barclays Global Inflation Linked 1-30yrs Index (USD hedged), 15 % BBG Barclays Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (USD unhedged), 10 % BBG Commodity TR Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed TR Index (USD unhedged), 15 % Alerian MLP TR Index, 5 % BBG Gold Subindex TR.*

[3] *OECD CPI + 3 % (3 Month Lag) - Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem 31. Januar 2013 berechnet.*

[4] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex seit Auflegung wird ab dem Auflegungsdatum der ältesten Anteilsklasse berechnet.*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein Engagement bei REITs trug, gemessen am FTSE EPRA/NAREIT Developed Net Total Return Index, zur absoluten Rendite bei.

» Ein Engagement bei Rohstoffen trug, gemessen am Bloomberg Commodity Total Return Index, zur absoluten Rendite bei.

» Ein Engagement bei MLPs trug, gemessen am Alerian MLP Index, zur absoluten Rendite bei.

» Eine Übergewichtung der brasilianischen nominalen Duration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die brasilianische nominale Duration deutlich zulegte.

» Eine Übergewichtung der US-Realduration trug zur relativen Wertentwicklung bei, da die US-Realrenditen zurückgingen.

» Eine Untergewichtung der nominalen US-Duration beeinträchtigte die relative Wertentwicklung, da die US-Nominalrenditen sanken.

# Low Average Duration Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 05. Dez. 2002) | 3,07 % | 2,80 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 05. Dez. 2002) | 3,04 % | 2,79 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2004) | 2,95 % | 2,55 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 03. Jul. 2003) | 2,97 % | 2,37 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 08. Sep. 2004) | 2,80 % | 2,35 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 21. Sep. 2007) | 2,69 % | 1,80 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 28. Okt. 2005) | 2,63 % | 2,08 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 04. Nov. 2009) | 2,93 % | 1,85 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | 2,95 % | 3,15 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 2,98 % | 1,03 % |
| ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index | 2,44 % | 2,10 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jan. 2012) | 1,56 % | 0,54 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 1,55 % | 2,21 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 24. Jul. 2009) | 1,05 % | 0,51 % |
| ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (EUR Hedged) | 0,87 % | 1,38 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Jan. 2017) | 2,12 % | 0,41 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Mrz. 2010) | 2,09 % | 1,60 % |
| ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (GBP Hedged) | 1,50 % | 0,81 %[2] |
| **Auf ILS lautende Klassen** | | |
| Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2010) | 1,85 % | 1,63 % |
| ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index (ILS Hedged) | 1,14 % | 0,93 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse positive Renditen erzielte.

» Eine übergewichtete Allokation auf Agency-MBS verstärkte die Wertentwicklung, da die Anlageklasse positive Renditen erzielte.

» Positionen bei Non-Agency-MBS trugen zur Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere positive Gesamtrenditen lieferten.

» Ein untergewichtetes Engagement bei britischer Duration belastete die Wertentwicklung, da die Renditen auf britische Staatsanleihen zurückgingen.

» Ein untergewichtetes Engagement bei italienischer Duration schmälerte die Wertentwicklung, da die Zinsen nachgaben.

# Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 4,32 % | 2,79 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged) | 4,25 % | 2,65 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Dez. 2016) | 2,53 % | 0,47 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (CHF Hedged) | 2,44 % | 0,41 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 2,79 % | 1,24 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 2,41 % | 0,34 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (EUR Hedged) | 2,65 % | 1,08 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 3,34 % | 2,06 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (GBP Hedged) | 3,27 % | 1,96 % |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Institutional NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Jul. 2017) | 3,55 % | 1,76 % |
| Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (NOK Hedged) | 3,42 % | 2,09 % |

[1] *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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Ein übergewichtetes Engagement in Finanzdienstleistungsfirmen, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da sich der Sektor im Berichtszeitraum überdurchschnittlich entwickelte.

» Ein übergewichtetes Engagement im Schwellenmarktsektor wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Spreads im Berichtszeitraum zunahmen.

» Ein übergewichtetes Engagement bei Banken, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Ein untergewichtetes Engagement bei der USD-Duration war der Wertentwicklung abträglich, da die Zinssätze im Berichtszeitraum stiegen.

» Ein untergewichtetes Engagement im Energiesektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, war der Wertentwicklung abträglich.

# Low Duration Income Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 4,78 % | 4,80 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 4,68 % | 4,78 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 4,30 % | 3,97 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 14. Sep. 2018) | 4,29 % | 3,80 % |
| Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index | 2,72 % | 3,96 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 3,05 % | 1,39 % |
| Institutional CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 2,95 % | 1,34 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 2,55 % | 0,55 % |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 2,57 % | 0,61 % |
| Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (CHF Hedged) | 0,94 % | 0,43 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 3,14 % | 1,75 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 2,94 % | 1,39 % |
| Investor EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 2,98 % | 1,39 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 2,75 % | 0,92 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 2,78 % | 0,99 % |
| Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (EUR Hedged) | 1,15 % | 0,86 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 3,62 % | 2,86 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 3,66 % | 2,88 % |
| Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (GBP Hedged) | 1,78 % | 2,11 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 31. Mai 2018) | 3,99 % | 3,25 % |
| Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index (SGD Hedged) | 2,39 % | 3,26 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein Engagement in US-Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze aufwärts tendierten.

» Ein Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein Engagement in US-Barzinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die kurzfristigen Zinsen weiterhin positiv sind.

» Eine Absicherungsposition gegenüber japanischer Duration belastete die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.

» Ein Short-Engagement bei britischer Duration belastete die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 17,54 % | (3,95 %) |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 17,53 % | (3,96 %) |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 21. Feb. 2018) | 17,26 % | 3,38 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2018) | 17,11 % | 5,02 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 16,78 % | (5,12 %) |
| Class E, ausschüttend II (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 16,59 % | (5,15 %) |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 07. Jun. 2019) | — | 1,60 % |
| Alerian MLP Index | 16,96 % | (7,77 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 15,54 % | (5,64 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 15,43 % | (5,63 %) |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Apr. 2018) | 15,33 % | 1,94 % |
| Alerian MLP Index EUR (Hedged) | 15,15 % | (9,11 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 16,05 % | (5,24 %) |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Nov. 2014) | 16,06 % | (5,21 %) |
| Alerian MLP Index GBP (Hedged) | 15,51 % | (8,80 %) |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Sektor für Erdgasbeförderung in Pipelines trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Index.

» Ein untergewichtetes Engagement im Sektor für die Beförderung von raffiniertem Petroleum in Pipelines trug zur relativen Rendite bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Vergleichsindex.

» Ein untergewichtetes Engagement im Inland- und Wassertransportsektor trug zur relativen Rendite bei, da der Sektor schlechter abschnitt als der Vergleichsindex.

» Positionen bei Zahlungsmitteläquivalenten trugen zur absoluten Rendite bei, da diese Wertpapiere positive Renditen lieferten.

» Die Titelauswahl und das untergewichtete Engagement im Sektor für Rohölbeförderung in Pipelines belasteten die relative Rendite, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt und sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex.

» Ein untergewichtetes Engagement bei Großhändlern von Petroleumprodukten schmälerte die relative Rendite, da der Sektor besser abschnitt als der Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Sektor für den Bau von Öl- und Gas-Pipelines war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Sektor.

# Mortgage Opportunities Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 2,94 % | 3,38 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 2,91 % | 3,41 % |
| Institutional, ausschüttend II (Auflegung: 17. Jan. 2018) | 2,98 % | 2,77 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2017) | 2,83 % | 2,49 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 2,84 % | 3,06 % |
| Administrative, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 2,76 % | 2,96 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 2,51 % | 2,51 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 2,46 % | 2,51 % |
| 3 Month USD LIBOR Index | 1,36 % | 1,93 %[2] |
| **Auf BRL lautende Klassen** | | |
| Institutional BRL (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Apr. 2018) | 5,41 % | (3,76 %) |
| ICE BofAML 3 Month USD LIBOR Index Hedged BRL Denominated in USD | 3,91 % | (4,21 %) |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 1,20 % | 0,45 % |
| Class E CHF (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2017) | 0,76 % | (1,66 %) |
| 3 Month USD LIBOR (in CHF besichert) | (0,41 %) | (0,99 %)[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 1,39 % | 0,90 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 1,34 % | 0,87 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Mai 2017) | 1,22 % | (0,14 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 1,01 % | 0,00 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Jun. 2017) | 0,88 % | (0,85 %) |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Aug. 2017) | 0,83 % | (1,80 %) |
| 3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index | (0,22 %) | (0,56 %)[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 2,05 % | 1,91 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 1,99 % | 1,90 % |
| Class Z GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Okt. 2017) | 2,30 % | 1,41 % |
| 3 Month USD LIBOR (GBP Hedged) Index | 0,38 % | 0,47 %[2] |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Class E HKD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2017) | 2,27 % | 1,15 % |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 08. Sep. 2017) | 2,20 % | 1,17 % |
| 3 Month HIBOR Index | 1,06 % | 1,67 %[2] |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Class E SGD (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 07. Jun. 2017) | 2,10 % | 1,06 % |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 25. Jan. 2017) | 2,15 % | 1,86 % |
| 3 Month SGD LIBOR Index | 1,01 % | (1,43 %)[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Long-Engagement bei US-Duration, da die US-Zinsen sanken.

» Ein Engagement bei Non-Agency-CMBS trug zur Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse positive Renditen erzielte.

» Ein Engagement bei RMBS trug zur Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse positive Renditen erzielte.

» Ein Engagement bei Collateralised Loan Obligations trug zur Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse positive Renditen erzielte.

» Ein Engagement bei Agency-MBS schmälerte die Wertentwicklung, da sich der Sektor unterdurchschnittlich entwickelte.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 9,43 % | 5,57 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 8,99 % | 4,66 % |
| MSCI Emerging Markets Index (Nettodividenden in USD) | 10,59 % | 4,48 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 9,76 % | 4,97 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 9,41 % | 4,09 % |
| Class Z EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 21. Jun. 2017) | 10,25 % | 5,71 % |
| MSCI Emerging Markets Index (EUR Unhedged) | 11,02 % | 3,91 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 9,50 % | 11,27 % |
| MSCI Emerging Markets Index (GBP Unhedged) | 10,67 % | 10,16 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE Emerging Markets Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI Emerging Markets Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Konkret richtet der Teilfonds unter normalen Umständen ein Engagement bei einem Portfolio von Aktien von Schwellenmarktunternehmen (das „RAE Emerging Markets Portfolio“) ein. Die Aktien werden vom Unterberater des Fonds, Research Affiliates, LLC, aus einem breiten Universum von Unternehmen ausgewählt, die bestimmte Liquiditäts- und Kapazitätsanforderungen erfüllen. Fondsstrategien können sich von Zeit zu Zeit ändern. Für nähere Einzelheiten zur Strategie des Fonds wird auf den aktuellen Verkaufsprospekt des Fonds verwiesen.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Energiesektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.

» Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.

» Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Finanzsektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Versorgungssektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Industriesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

# PIMCO RAE Europe Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 11,04 % | 1,85 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 10,64 % | 0,99 % |
| MSCI Europe Index | 16,24 % | 3,07 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 10,76 % | 7,97 % |
| MSCI Europe Index (GBP Unhedged) | 15,88 % | 9,26 % |
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional USD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 10,66 % | 2,41 % |
| Class E USD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 10,26 % | 1,56 % |
| MSCI Europe Index (USD Unhedged) | 15,80 % | 3,63 % |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE Europe Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI Europe Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Konkret richtet der Teilfonds unter normalen Umständen ein Engagement bei einem Portfolio von Aktien europäischer Unternehmen (das „RAE Europe Portfolio“) ein. Die Aktien werden vom Unterberater des Fonds, Research Affiliates, LLC, aus einem breiten Universum von Unternehmen ausgewählt, die bestimmte Liquiditäts- und Kapazitätsanforderungen erfüllen. Fondsstrategien können sich von Zeit zu Zeit ändern. Für nähere Einzelheiten zur Strategie des Fonds wird auf den aktuellen Verkaufsprospekt des Fonds verwiesen.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Industriesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.

» Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanzsektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement im Kommunikationsdienstleistungssektor war der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schlechter entwickelte als der Index.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Versorgungssektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 11,51 % | 5,53 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 11,02 % | 4,64 % |
| MSCI World Index | 16,98 % | 7,94 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 11,89 % | 4,97 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 11,50 % | 4,07 % |
| MSCI World Index (EUR Unhedged) | 17,43 % | 7,35 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 11,65 % | 11,27 % |
| MSCI World Index (GBP Unhedged) | 17,06 % | 13,80 % |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE Global Developed Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI World Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Konkret richtet der Teilfonds unter normalen Umständen ein Engagement bei einem Portfolio von Aktien von Unternehmen aus Industrieländern weltweit (das „RAE Global Developed Portfolio“) ein. Die Aktien werden vom Unterberater des Fonds, Research Affiliates, LLC, aus einem breiten Universum von Unternehmen ausgewählt, die bestimmte Liquiditäts- und Kapazitätsanforderungen erfüllen. Fondsstrategien können sich von Zeit zu Zeit ändern. Für nähere Einzelheiten zur Strategie des Fonds wird auf den aktuellen Verkaufsprospekt des Fonds verwiesen.

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

» Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Informationstechnologiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Kommunikationsdienstleistungssektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Versorgungssektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Energiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 03. Sep. 2013) | 10,93 % | 5,02 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 13. April 2016) | 11,61 % | 4,26 % |
| MSCI Emerging Markets Index (Nettodividenden in USD) | 10,59 % | 4,54 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Sep. 2013) | 11,39 % | 7,65 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2013) | 10,61 % | 5,28 % |
| G Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 11. Sep. 2015) | 11,40 % | 12,53 % |
| MSCI Emerging Markets Index (EUR Unhedged) | 11,02 % | 7,16 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI Emerging Markets Index, liegende Gesamtrendite an. Hierzu befolgt der Teilfonds die unternehmenseigene Portfoliomanagementstrategie der Anlageberatungsgesellschaft, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (die ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) bestehendes Portfolio mit Engagements in ein nominelles, aus Aktienwerten bestehendes Portfolio verbindet, wodurch im Laufe der Zeit eine bessere Wertentwicklung als die eines Aktienindex, in diesem Fall des MSCI Emerging Markets Index, erreicht werden soll). Das nominelle, aus Aktienwerten bestehende Portfolio wird aufgrund der RAE Emerging Markets Strategy (wie im Verkaufsprospekt näher erklärt) ausgewählt.

## Kommentare zum Fonds

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

- Das Engagement des Teilfonds bei der RAE Emerging Markets-Strategie war der Rendite im Vergleich zum MSCI Emerging Markets Index zuträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
  - Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Energiesektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor stärker entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
  - Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor trugen zur relativen Rendite bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der Vergleichsindex.
  - Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Industriesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
  - Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Versorgungssektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.
  - Die Titelauswahl im Finanzsektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.
  - Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor besser entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.
- Die Alpha-Anleihenstrategie des Portfolios war der Rendite zuträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:
  - US-Durationsstrategien trugen zur Wertentwicklung bei, da die Renditen auf breiter Front zurückgingen.
  - Short-Engagements in Großbritannien waren der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen zurückgingen.
  - Short-Engagements bei langfristigen japanischen Anleihen waren der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen zurückgingen.
  - Beteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment Grade waren der Rendite zuträglich.
  - Positionen bei Non-Agency-MBS trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen stieg.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 03. Sep. 2013) | 12,57 % | 7,27 % |
| MSCI World Index | 16,98 % | 8,89 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Sep. 2013) | 13,00 % | 9,96 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 25. Sep. 2013) | 12,34 % | 8,10 % |
| G Institutional EUR (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 28. Feb. 2014) | 12,96 % | 8,75 % |
| MSCI World Index (EUR Unhedged) | 17,43 % | 11,63 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (abgesichert)** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Sep. 2014) | 11,01 % | 4,44 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 22. Sept. 2014) | 10,34 % | 3,01 % |
| MSCI World Index (EUR Hedged) | 15,37 % | 6,75 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 03. Sep. 2013) | 12,63 % | 11,01 % |
| MSCI World Index (GBP Unhedged) | 17,06 % | 12,68 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem MSCI World Index, liegende Gesamtrendite an. Hierzu befolgt der Teilfonds die unternehmenseigene Portfoliomanagementstrategie der Anlageberatungsgesellschaft, die als „StocksPLUS“ bekannt ist (die ein aktiv verwaltetes, aus Rentenwerten (wie im Verkaufsprospekt definiert) bestehendes Portfolio mit Engagements in ein nominelles, aus Aktienwerten bestehendes Portfolio verbindet, wodurch im Laufe der Zeit eine bessere Wertentwicklung eines Aktienindex, in diesem Fall des MSCI World Index, erreicht werden soll). Das nominelle, aus Aktienwerten bestehende Portfolio wird aufgrund der RAE Fundamental Global Developed-Strategie (wie im Fondsnachtrag näher erklärt) ausgewählt.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement des Teilfonds bei der RAE Fundamental Global Developed-Strategie war der Rendite im Vergleich zum MSCI World Index abträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:

  » Die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten 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 Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.

  » Die Titelauswahl im Kommunikationsdienstleistungssektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

  » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Versorgungssektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.

  » Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Energiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.

» Die Alpha-Anleihenstrategie des Portfolios war der Rendite zuträglich. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:

  » US-Durationsstrategien verstärkten die Wertentwicklung, da die Renditen auf breiter Front zurückgingen.

  » Short-Engagements in Großbritannien waren der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen zurückgingen.

  » Short-Engagements bei langfristigen japanischen Anleihen waren der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen zurückgingen.

  » Beteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment Grade waren der Rendite zuträglich.

  » Positionen bei Non-Agency-MBS trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen stieg.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 13,62 % | 7,49 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 13,06 % | 6,57 % |
| S&P 500 Index | 18,18 % | 10,86 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 14,00 % | 7,00 % |
| Class E EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 13,50 % | 5,97 % |
| S&P 500 (EUR Unhedged) Index | 18,63 % | 10,26 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 13,65 % | 13,32 % |
| S&P 500 (GBP Unhedged) Index | 18,26 % | 16,89 % |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAE US Fund strebt eine über seinem Vergleichsindex, dem S&P 500 Index, liegende Gesamtrendite an (wie im Verkaufsprospekt näher beschrieben ist). Konkret richtet der Fonds unter normalen Umständen ein Engagement bei einem Portfolio von Aktien US-amerikanischer Unternehmen (das „RAE US Portfolio“) ein. Die Aktien werden vom Unterberater des Fonds, Research Affiliates, LLC, aus einem breiten Universum von Unternehmen ausgewählt, die bestimmte Liquiditäts- und Kapazitätsanforderungen erfüllen. Fondsstrategien können sich von Zeit zu Zeit ändern. Für nähere Einzelheiten zur Strategie des Fonds wird auf den aktuellen Verkaufsprospekt des Fonds verwiesen.

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Finanzsektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Kommunikationsdienstleistungssektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten 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 Teilfonds schlechter abschnitten als der Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Gesundheitssektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Energiesektor waren der relativen Rendite abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

# PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Nov. 2018) | 10,01 % | 8,80 % |
| RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Index | 10,39 % | 9,13 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Nov. 2018) | 10,45 % | 8,90 % |
| RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Index (EUR Unhedged) | 10,81 % | 9,20 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Nov. 2018) | 10,13 % | 9,80 % |
| RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Index (GBP Unhedged) | 10,46 % | 10,09 % |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund strebt eine Gesamtrendite an, die vor Gebühren und Aufwendungen möglichst genau der Gesamtrendite des RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Index (der „Index“) entspricht. Der Teilfonds verfolgt sein Anlageziel, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Gesamtvermögens direkt in die Bestandteile des Index investiert.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Kommunikationsdienstleistungssektor trugen zur relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Emerging Markets Index, bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der sekundäre Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor trug zur relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Emerging Markets Index, bei, da die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Grundstoffsektor trug zur relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Emerging Markets Index, bei, da die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor waren der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Emerging Markets Index, abträglich, da sich der Sektor stärker entwickelte als der sekundäre Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Versorgungssektor waren der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Emerging Markets Index, abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schwächer entwickelten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Informationstechnologiesektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Emerging Markets Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

# PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Nov. 2018) | 14,09 % | 7,70 % |
| RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Index | 14,20 % | 7,94 % |
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional USD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Nov. 2018) | 13,62 % | 7,60 % |
| RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Index (USD Unhedged) | 13,77 % | 7,88 % |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund strebt eine Gesamtrendite an, die vor Gebühren und Aufwendungen möglichst genau der Gesamtrendite des RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Index (der „Index“) entspricht. Der Teilfonds verfolgt sein Anlageziel, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Gesamtvermögens direkt in die Bestandteile des Index investiert.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanzsektor trugen zur relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Europe Index, bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der sekundäre Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Europe Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Industriesektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Europe Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement im Kommunikationsdienstleistungssektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Europe Index, abträglich, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Versorgungssektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Europe Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Gesundheitssektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI Europe Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Nov. 2018) | 14,27 % | 5,70 % |
| RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Index | 14,21 % | 5,84 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Nov. 2018) | 14,75 % | 5,80 % |
| RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Index (EUR Unhedged) | 14,65 % | 5,90 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Nov. 2018) | 14,38 % | 6,60 % |
| RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Index (GBP Unhedged) | 14,29 % | 6,76 % |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund strebt eine Gesamtrendite an, die vor Gebühren und Aufwendungen möglichst genau der Gesamtrendite des RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Index (der „Index“) entspricht. Der Teilfonds verfolgt sein Anlageziel, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Gesamtvermögens direkt in die Bestandteile des Index investiert.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das untergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Finanzsektor trugen zur relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI World Index, bei, da sich der Sektor schwächer entwickelte als der sekundäre Vergleichsindex und die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Kommunikations-dienstleistungssektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI World Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor waren der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI World Index, abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schwächer entwickelten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI World Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Industriesektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI World Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Energiesektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem MSCI World Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

# PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Nov. 2018) | 15,95 % | 5,40 % |
| RAFI Dynamic Multi-Factor US Net TR Index | 16,15 % | 5,50 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Nov. 2018) | 16,45 % | 5,50 % |
| RAFI Dynamic Multi-Factor US Net TR Index (EUR Unhedged) | 16,59 % | 5,56 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Nov. 2018) | 16,03 % | 6,40 % |
| RAFI Dynamic Multi-Factor US Net TR Index (GBP Unhedged) | 16,23 % | 6,42 % |

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund strebt eine Gesamtrendite an, die vor Gebühren und Aufwendungen möglichst genau der Gesamtrendite des RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Index (der „Index“) entspricht. Der Teilfonds verfolgt sein Anlageziel, indem er unter normalen Umständen mindestens 80 % seines Gesamtvermögens direkt in die Bestandteile des Index investiert.

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Finanzsektor trug zur relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem S&P 500 Index, bei, da die Beteiligungen des Teilfonds besser abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem S&P 500 Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Kommunikationsdienstleistungssektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem S&P 500 Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Basiskonsumgütersektor waren der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem S&P 500 Index, abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schwächer entwickelten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Das übergewichtete Engagement und die Titelauswahl im Energiesektor waren der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem S&P 500 Index, abträglich, da sich der Sektor und die Beteiligungen des Teilfonds schwächer entwickelten als der sekundäre Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Immobiliensektor war der relativen Rendite gegenüber dem sekundären Vergleichsindex des Teilfonds, dem S&P 500 Index, abträglich, da die Beteiligungen des Teilfonds schlechter abschnitten als der sekundäre Vergleichsindex.

# Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 16. Apr. 2010) | 10,57 % | 5,39 % |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter | 10,70 % | 6,13 % |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2013) | 8,80 % | 3,23 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Okt. 2017) | 8,91 % | 1,07 % |
| Class E EUR (Hedged) thesaurierend (Auflegung: 31. Aug. 2018) | 8,34 % | 7,80 % |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter (EUR Hedged) | 9,00 % | 4,15 %[2] |
| **Auf NOK lautende Klassen** | | |
| Investor NOK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 17. Mrz. 2014) | 9,39 % | 4,53 % |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter (NOK Hedged) | 9,76 % | 5,52 % |
| **Auf SEK lautende Klassen** | | |
| Investor SEK (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 06. Feb. 2014) | 8,77 % | 3,04 % |
| JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter (SEK Hedged) | 9,15 % | 4,29 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Socially Responsible Emerging Markets Bond 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 von den Anlageberatungsgesellschaften gemäß einem ethischen Auswahlverfahren ausgewählt, das die sozial verantwortliche Anlageberatungsgesellschaft (wie im Verkaufsprospekt definiert) von Zeit zu Zeit vorgibt.

## Kommentare zum Fonds

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

» Übergewichtete Engagements bei ukrainischen Staatsanleihen trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Ukraine die Wertentwicklung des Index übertraf.

» Ein nicht im Vergleichsindex enthaltenes Engagement bei ausgewählten Lokalwährungen von Schwellenländern, die eine positive Gesamtrendite erzielten, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.

» Ein Engagement bei brasilianischen Unternehmensanleihen, die die Wertentwicklung des Index übertrafen, wirkte sich positiv auf die relative Wertentwicklung aus.

» Eine Untergewichtung der US-Duration auf Portfolioebene schmälerte die relative Wertentwicklung, da US-Zinsen sanken.

» Die Titelauswahl in Mexiko war der relativen Wertentwicklung abträglich.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Dez. 1998) | 19,54 % | 6,40 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 22. Nov. 2001) | 19,58 % | 7,77 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 07. Jan. 1999) | 19,37 % | 5,88 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 11. Sep. 2006) | 19,00 % | 8,05 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 03. Jan. 2017) | 18,71 % | 11,81 % |
| S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden) | 18,18 % | 5,75 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2012) | 17,68 % | 12,31 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 17,62 % | 7,61 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 02. Aug. 2017) | 17,11 % | 7,25 % |
| S&P 500 (EUR Hedged) Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden) | 16,28 % | 6,57 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement des Teilfonds bei mit dem S&P 500 verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 eine Rendite von 18,54 % 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.

  » Short-Engagements in Großbritannien waren der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen zurückgingen.

  » Short-Engagements bei langfristigen japanischen Anleihen waren der Wertentwicklung abträglich, da die Renditen zurückgingen.

  » Beteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment Grade waren der Rendite zuträglich.

  » Positionen bei Non-Agency-MBS trugen zur Rendite bei, da der Wert dieser Anleihen stieg.

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019) | — | 5,40 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 29. Mrz. 2019) | — | 5,10 % |
| S&P 500 Index (nach Abzug der Quellensteuer auf Dividenden) | — | 4,15 % |

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

* Die Wertentwicklung eines neuen oder kleineren Fonds ist für die voraussichtliche langfristige Wertentwicklung des Fonds, nachdem er größer geworden ist und seine Anlagestrategien vollständig umgesetzt hat, gegebenenfalls nicht repräsentativ. Bei neuen und kleineren Fonds wie dem Teilfonds können Anlagepositionen eine übermäßige (positive oder negative) Auswirkung auf die Wertentwicklung haben. Beispielsweise kann die Wertentwicklung bestimmter Anlagestrategien vom Kauf kleinerer Positionsgrößen bei bestimmten Anlagen (d.h. Odd Lot-Positionen) profitieren. Die Auswirkungen dieser Anlagen auf die Wertentwicklung können für einen neuen und kleineren Fonds wie den Teilfonds besonders stark sein. Mit zunehmender Größe des Fonds stellt dies jedoch gegebenenfalls keine nachhaltige Quelle der Wertentwicklung dar. Neue und kleinere Fonds benötigen außerdem gegebenenfalls einige Zeit, bevor sie in Wertpapieren investiert sind, die ihren Anlagezielen und ihrer Anlagepolitik entsprechen, und bevor sie eine repräsentative Portfoliozusammensetzung erreichen. Die Wertentwicklung des Fonds kann in dieser Anlaufphase niedriger oder höher sein, und sie kann außerdem eine stärkere Volatilität aufweisen, als dies nach vollständiger Anlage des Fonds der Fall wäre. Ebenso kann es länger dauern, bis die Anlagestrategie eines neuen oder kleineren Fonds Renditen erzielt, die für die Strategie repräsentativ sind. Für neue Fonds liegen nur beschränkte Daten zur vergangenen Wertentwicklung vor, die Anleger beurteilen können, und neue und kleinere Fonds erzielen gegebenenfalls keine ausreichende Kapitalhöhe, um effizient investieren und handeln zu können. Wenn ein neuer oder kleinerer Fonds seine Anlagestrategien nicht erfolgreich umsetzt oder sein Anlageziel nicht erreicht, kann die Wertentwicklung beeinträchtigt werden, und eine gegebenenfalls daraus resultierende Liquidation könnte negative Transaktionskosten für den Fonds und steuerliche Konsequenzen für Anleger zur Folge haben.

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

Der Fonds nahm die Geschäftstätigkeit am 29. März 2019 auf.

## Kommentare zum Fonds

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

» Das Engagement des Teilfonds bei mit dem S&P 500 verbundenen Aktienindexderivaten wirkte sich in den drei Monaten bis Juni 2019 positiv auf die absolute Rendite aus, da der S&P 500 eine Rendite von 4,30 % verbuchte.

» Die Alpha-Anleihenstrategie des Portfolios trug zur Wertentwicklung bei. Die Wertentwicklung war vor allem auf die folgenden Faktoren zurückzuführen:

  » US-Durationsstrategien trugen zur Wertentwicklung bei, da die Renditen auf breiter Front zurückgingen.

  » Beteiligungen an Unternehmensanleihen mit Investment Grade und hochverzinslichen Unternehmensanleihen waren der Rendite zuträglich.

  » Ein Engagement in Agency-MBS schmälerte die Rendite.

  » Ein Engagement in US TIPS-Breakeven-Titeln schmälerte die Rendite.

  » Illiquiditätsaufschläge, die durch den Kauf kleinerer Positionen an CMBS und RMBS (d.h. Odd Lot-Positionen) und deren Ansatz zu Round Lot-Bewertungen erzielt wurden, trugen zur Wertentwicklung bei.*

# Strategic Income Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 14. Mrz. 2018) | 7,61 % | 3,61 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013) | 7,12 % | 4,54 % |
| Class E, ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013) | 7,06 % | 4,53 % |
| 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index[3] | 8,79 % | 5,12 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013) | 5,94 % | 4,35 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 16. Dez. 2013) | 5,53 % | 3,39 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 16. Dez. 2013) | 5,43 % | 3,39 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 5,32 % | 1,81 % |
| Class T EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 5,33 % | 1,83 % |
| 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate EUR Hedged/25 % MSCI World Index EUR Hedged[4] | 7,16 % | 3,99 %[2] |

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

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

[3] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Strategic Income Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 26. Juli 2016: 75 % Barclays Global Aggregate Index Hedged USD / 25 % MSCI All Country World Index. Seit dem 27. Juli 2016: 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index*

[4] *Die Wertentwicklung des Vergleichsindex für den Strategic Income Fund repräsentiert Folgendes: Von der Auflegung bis zum 26. Juli 2016: 75 % Barclays Global Aggregate Index Hedged EUR/ 25 % MSCI All Country World Index Net EUR. Seit dem 27. Juli 2016: 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate EUR Hedged/25 % MSCI World Index EUR Hedged*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

Der Strategic Income Fund strebt unter Anwendung einer umsichtigen Anlageverwaltung attraktive laufende Erträge an. Das sekundäre Anlageziel besteht im langfristigen Kapitalzuwachs. Der Teilfonds verwendet eine globale Multi-Sektor-Strategie, mit der der Gesamtrendite-Anlageprozess und die Philosophie der Anlageverwaltungs-gesellschaften 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 Einfluss auf die Wertentwicklung:

» Ein Engagement in US-Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die Zinssätze aufwärts tendierten.

» Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade und hochverzinslichen Unternehmensanleihen trugen zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein Engagement in US-Barzinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die kurzfristigen Zinsen positiv blieben.

» Absicherungsposition gegenüber der Duration von Industrieländern, insbesondere in Japan und Großbritannien, belasteten die Wertentwicklung, da die Zinsen stiegen.

» Die Titelauswahl im Finanzsektor trug zur relativen Rendite bei, da sich die Beteiligungen des Teilfonds besser entwickelten als der Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Nicht-Basiskonsumgütersektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

» Die Titelauswahl im Kommunikations-dienstleistungssektor war der relativen Rendite abträglich, da sich die Beteiligungen des Teilfonds schlechter entwickelten als der Vergleichsindex.

# Total Return Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 31. Jan. 1998) | 6,38 % | 5,40 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Apr. 2000) | 6,37 % | 5,49 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 28. Jan. 1999) | 6,18 % | 4,85 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 23. Okt. 2000) | 6,18 % | 4,90 % |
| Administrative, thesaurierend (Auflegung: 16. Mai 2003) | 6,15 % | 4,02 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 5,92 % | 4,04 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 10. Okt. 2005) | 5,94 % | 3,88 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002) | 6,29 % | 4,69 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 25. Mai 2018) | 6,26 % | 6,65 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 6,27 % | 2,17 % |
| Class R, ausschüttend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 6,24 % | 2,17 % |
| Class T, thesaurierend (Auflegung: 16. Okt. 2014) | 5,72 % | 1,85 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate Index | 6,11 % | 4,88 %[2] |
| **Auf CAD lautende Klassen** | | |
| Institutional CAD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 02. Mai 2013) | 5,90 % | 2,34 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate Index (CAD Hedged) | 5,59 % | 2,52 % |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011) | 4,55 % | 1,50 % |
| Investor CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011) | 4,38 % | 1,15 % |
| Class E CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 19. Sept. 2012) | 4,10 % | (0,13 %) |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (CHF Hedged) Index | 4,24 % | 1,46 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2003) | 4,81 % | 3,93 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 4,75 % | 4,02 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Dez. 2004) | 4,60 % | 3,49 % |
| Administrative EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 14. Okt. 2009) | 4,50 % | 2,36 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 4,32 % | 3,25 % |
| Class E EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 07. Mrz. 2012) | 4,25 % | 0,85 % |
| Class R EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 4,55 % | 0,85 % |
| Class T EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2014) | 4,12 % | 0,25 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (EUR Hedged) Index | 4,50 % | 3,35 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen (nicht abgesichert)** | | |
| Institutional EUR (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Jun. 2002) | 6,78 % | 3,71 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate Index (EUR Unhedged) Index | 6,52 % | 3,25 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 26. Mrz. 2010) | 5,40 % | 3,26 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 5,42 % | 4,80 % |
| Investor GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jun. 2011) | 5,22 % | 2,40 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (GBP Hedged) Index | 5,18 % | 4,22 %[2] |
| **Auf HKD lautende Klassen** | | |
| Class E HKD (Unhedged), thesaurierend (Auflegung: 20. Feb. 2013) | 5,76 % | 1,80 % |
| M Retail HKD (Unhedged), ausschüttend (Auflegung: 20. Feb. 2013) | 5,76 % | 1,75 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (HKD Unhedged) Index | 5,88 % | 2,84 % |
| **Auf ILS lautende Klassen** | | |
| Institutional ILS (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 13. Mai 2010) | 5,11 % | 3,24 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (ILS Hedged) Index | 4,81 % | 3,38 % |

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» US-Zinsstrategien, insbesondere eine Übergewichtung des Bauchs der Zinsstrukturkurve, trugen zur relativen Wertentwicklung bei, da die Zinsen sanken.

» Ein übergewichtetes Engagement bei Kreditwerten aus dem Finanzsektor trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein übergewichtetes Engagement bei auf US-Dollar lautenden Auslandsschulden von Schwellenländern trug zur relativen Wertentwicklung bei, da sich die Spreads verengten.

» Ein Short-Engagement bei australischer Duration war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen sanken.

» Ein Short-Engagement bei japanischer Duration war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen sanken.

» Ein Short-Engagement bei britischer Duration war der relativen Wertentwicklung abträglich, da die Zinsen sanken.

Gesamtrendite nach Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1] (Forts.)

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf JPY lautende Klassen** | | |
| Institutional JPY (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 24. Jul. 2014) | 4,91 % | 1,36 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (JPY Hedged) Index | 4,48 % | 1,30 % |
| **Auf SGD lautende Klassen** | | |
| Institutional SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 11. Jan. 2011) | 6,07 % | 3,25 % |
| Class E SGD (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Feb. 2007) | 5,55 % | 3,56 % |
| Class E SGD (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 01. Aug. 2012) | 5,46 % | 1,64 % |
| Bloomberg Barclays US Aggregate (SGD Hedged) Index | 5,76 % | 3,90 %[2] |

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

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

# PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 1,43 % | 1,56 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 1,40 % | 1,57 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 1,25 % | 1,20 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 0,89 % | 0,47 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 0,85 % | 0,45 % |
| 3 Month USD LIBOR Index | 1,36 % | 1,40 %[2] |
| **Auf CHF lautende Klassen** | | |
| Institutional CHF (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | (0,21 %) | (0,91 %) |
| 3 Month USD LIBOR (in CHF besichert) | (0,41 %) | (1,09 %) |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | (0,10 %) | (0,38 %) |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 0,02 % | (0,36 %) |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 30. Jun. 2015) | (0,63 %) | (1,46 %) |
| 3 Month USD LIBOR (EUR Hedged) Index | (0,22 %) | (0,27 %) |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Jun. 2015) | 0,48 % | 0,76 % |
| 3 Month USD LIBOR (GBP Hedged) Index | 0,38 % | 0,42 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Long-Positionen in australischer, europäischer und US-amerikanischer Duration trugen zur Wertentwicklung bei.

» Long-Positionen bei australischen Aktien trugen zur Wertentwicklung bei.

» Die Positionierung bei Aktienindizes in Offshore-China, Singapur und den USA belastete die Wertentwicklung aufgrund scharfer Kursumschwünge.

» Short-Positionen im australischen Dollar, im kanadischen Dollar und im britischen Pfund schmälerten während eines Großteils des Berichtszeitraums die Wertentwicklung aufgrund von Kursumschwüngen.

» Short-Positionen auf die implizite Volatilität US-amerikanischer Aktien waren der Wertentwicklung abträglich, da die implizite Volatilität ihren Trend umkehrte und im zweiten Quartal 2019 zulegte.

» Das Sicherheitenportfolio trug zur Rendite bei, was vor allem Zugewinnen bei kurzfristigen Unternehmensanleihen zu verdanken war.

# UK Corporate Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Sep. 2007) | 7,16 % | 6,56 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 08. Jul. 2016) | 7,17 % | 4,09 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 08. Jun. 2016) | 6,96 % | 4,76 % |
| ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index | 6,31 % | 6,02 %[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein übergewichtetes Engagement im Bankensektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Ein übergewichtetes Engagement bei der USD-Duration wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Zinssätze im Berichtszeitraum stiegen.

» Ein übergewichtetes Engagement bei REITs, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Ein untergewichtetes Engagement im Versorgungssektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, war der Wertentwicklung abträglich.

» Ein untergewichtetes Engagement im Versicherungssektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, war der Wertentwicklung abträglich.

# UK Long Term Corporate Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2005) | 10,45 % | 6,78 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 14. Aug. 2008) | 10,43 % | 8,96 % |
| ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index[3] | 9,89 % | 6,19 %[2] |

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

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

[3] *Die Benchmark-Performance für den UK Long Term Corporate Bond Fund repräsentiert Folgendes: 31. Dezember 2005 bis 31. März 2013 — (Markit iBoxx Sterling Non-Gilts 10+ Index); ab 31. März 2013 — (ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index).*

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Ein übergewichtetes Engagement im Bankensektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Ein übergewichtetes Engagement bei der USD-Duration wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus, da die Zinssätze im Berichtszeitraum stiegen.

» Ein übergewichtetes Engagement bei REITs, die sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelten, wirkte sich positiv auf die Wertentwicklung aus.

» Ein untergewichtetes Engagement im Versorgungssektor, der sich während des Berichtszeitraums überdurchschnittlich entwickelte, war der Wertentwicklung abträglich.

» Die Titelauswahl im Transportsektor war der Wertentwicklung abträglich, da sich ein ausgewählter untergewichteter Emittent während des Berichtszeitraums unterdurchschnittlich entwickelte.

# US High Yield Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 28. Mai 1998) | 10,22 % | 6,20 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 23. Jan. 2001) | 10,25 % | 6,69 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 18. Mrz. 1999) | 9,99 % | 5,87 % |
| Investor, ausschüttend (Auflegung: 14. Jan. 1999) | 10,04 % | 5,84 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 9,72 % | 5,27 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 31. Jul. 2006) | 9,72 % | 5,40 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Okt. 2002) | 10,11 % | 7,72 % |
| M Retail, ausschüttend (Auflegung: 11. Jan. 2012) | 9,64 % | 5,62 % |
| Class R, thesaurierend (Auflegung: 30. Nov. 2012) | 10,08 % | 5,47 % |
| Class Z, thesaurierend (Auflegung: 29. Jun. 2016) | 10,45 % | 7,94 % |
| ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index[2] | 10,16 % | 6,33 %[3] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 10. Apr. 2003) | 8,51 % | 6,11 % |
| Institutional EUR (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 30. Dez. 2005) | 8,57 % | 5,38 % |
| Investor EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 12. Feb. 2003) | 8,32 % | 6,10 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 31. Mrz. 2006) | 7,99 % | 4,38 % |
| ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (EUR Hedged)[3] | 8,44 % | 6,79 %[2] |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 30. Sep. 2003) | 8,98 % | 6,70 % |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend (Auflegung: 22. Jun. 2016) | 8,96 % | 5,70 % |
| ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (GBP Hedged)[3] | 8,91 % | 7,14 %[2] |

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

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Die Titelauswahl im Bankensektor trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Bankensektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.

» Die Titelauswahl im Metall- und Bergbausektor trug zur Wertentwicklung bei, da die Positionen des Fonds im Metall- und Bergbausektor besser abschnitten als der Sektor insgesamt.

» Die Titelauswahl bei nicht zyklischen Konsumgütern verstärkte die Wertentwicklung, da die Positionen des Fonds bei nicht zyklischen Konsumgütern besser abschnitten als der Sektor insgesamt.

» Die Titelauswahl im Gesundheitssektor war der Wertentwicklung abträglich, da die Positionen des Fonds im Gesundheitssektor schlechter abschnitten als der Sektor insgesamt.

» Ein untergewichtetes Engagement im Einzelhandelssektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.

» Ein untergewichtetes Engagement im Bankensektor beeinträchtigte die Wertentwicklung, da dieser Sektor den Gesamtmarkt übertraf.

# US Investment Grade Corporate Bond Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016) | 10,61 % | 5,04 % |
| Institutional, ausschüttend (Auflegung: 15. Sep. 2016) | 10,61 % | 5,06 % |
| Class E, ausschüttend (Auflegung: 08. Mrz. 2019) | — | 6,25 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 09. Aug. 2017) | 10,53 % | 4,77 % |
| H Institutional, ausschüttend (Auflegung: 09. Aug. 2017) | 10,47 % | 4,71 % |
| Bloomberg Barclays US Credit Index | 9,35 % | 3,93 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 15. Sep. 2016) | 8,85 % | 2,46 % |
| Bloomberg Barclays US Credit Index (EUR Hedged) | 7,68 % | 1,34 % |
| **Auf GBP lautende Klassen** | | |
| Institutional GBP (Hedged), ausschüttend II (Auflegung: 15. Sep. 2016) | 9,50 % | 3,55 % |
| Bloomberg Barclays US Credit Index (GBP Hedged) | 8,35 % | 2,44 % |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Eine taktische Allokation auf europäische CoCo-/Tier-1-Papiere trug zur Wertentwicklung bei, da sich die Anlageklasse stärker entwickelte als der Bloomberg Barclays US Credit Index.

» Eine taktische Allokation auf externe Schwellenmärkte trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor positive Gesamtrenditen verbuchte.

» Eine Übergewichtung des Glücksspielsektors trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor besser abschnitt als der Bloomberg Barclays US Credit Index.

» Eine Übergewichtung des Festnetzsektors trug zur Wertentwicklung bei, da der Sektor besser abschnitt als der Bloomberg Barclays US Credit Index.

» Eine Untergewichtung des Einzelhandelssektors schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor besser abschnitt als der Bloomberg Barclays US Credit Index.

» Eine Untergewichtung des Pharmasektors schmälerte die Wertentwicklung, da der Sektor besser abschnitt als der Bloomberg Barclays US Credit Index.

# US Short-Term Fund

## Gesamtrendite, netto ohne Gebühren und Aufwendungen für den am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum[1]

| | 6 Monate | Auflegung von Klassen |
|---|---|---|
| **Auf USD lautende Klassen** | | |
| Institutional, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014) | 1,57 % | 1,89 % |
| Investor, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014) | 1,41 % | 1,53 % |
| Class E, thesaurierend (Auflegung: 30. Jun. 2014) | 1,32 % | 1,49 % |
| H Institutional, thesaurierend (Auflegung: 12. Dez. 2018) | 1,40 % | 1,30 % |
| Class Z, ausschüttend (Auflegung: 07. Aug. 2014) | 1,76 % | 2,37 % |
| FTSE 3-Month US Treasury Bill Index | 1,21 % | 0,84 %[2] |
| **Auf EUR lautende Klassen** | | |
| Institutional EUR (Hedged), thesaurierend (Auflegung: 29. Jan. 2016) | 0,00 % | 0,32 % |
| Class E EUR (Hedged), thesaurierende Anteile (Auflegung: 08. Jun. 2016) | (0,20 %) | (0,39 %) |
| ICE BofA Merrill Lynch 3-Month Treasury Bill Index (EUR Hedged) | (0,31 %) | (0,95 %)[2] |

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

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

## Anlageziel und Überblick über die Strategie

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

## Kommentare zum Fonds

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

» Positionen bei Unternehmensanleihen mit Investment Grade trugen zur Wertentwicklung bei, da die Anlageklasse/diese Wertpapiere positive Renditen erzielten.

» Positionen bei Non-Agency-MBS trugen zur Wertentwicklung bei, da diese Wertpapiere positive Gesamtrenditen lieferten.

» Eine Übergewichtung kanadischer zweijähriger Zinsen trug zur Wertentwicklung bei, da die zweijährigen kanadischen Zinsen zurückgingen.

» Ein untergewichtetes Engagement beim 5-jährigen Teil der Zinsstrukturkurve für US-Schatzpapiere schmälerte die Wertentwicklung, da 5-jährige Zinsen sanken.

» Ein untergewichtetes Engagement bei hochverzinslichen Unternehmensanleihen schmälerte die Wertentwicklung, da die Anlageklasse starke Gesamtrenditen erzielte.

## Beschreibungen der Vergleichsindizes

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **1 Month CHF LIBOR Index** | Der 1 Month CHF LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. |
| **1 Month Euribor Index** | Der 1 Month Euribor (Euro Interbank Offered Rate) Index ist der Vergleichszinssatz des ausgedehnten Euro-Geldmarkts. Dieser Index wird von der European Banking Federation, die 2.800 Banken in den fünfzehn Mitgliedsstaaten der Europäischen Union repräsentiert, und von der EWU-Abteilung der ACI, einer global agierenden Finanzmarktvereinigung, betrieben. Eine repräsentative Auswahl der wichtigsten Banken liefert tägliche Kurse für dreizehn Fälligkeiten von einer Woche bis zu einem Jahr, zu denen auf Euro lautende Interbank-Festgelder in der Eurozone zwischen den wichtigsten Banken gehandelt werden. Der durchschnittliche Zinssatz errechnet sich nach Löschen der höchsten/niedrigsten Kurse (15 % auf beiden Seiten). Der Euribor wird zu Kassavalutierung (T+2) und zu tatsächlichen/360-Tagessatzbedingungen angeboten und seit dem 4. Januar 1999 auf drei Kommastellen genau angegeben. Er wird 11:00 Uhr vormittags Brüsseler Zeit verbreitet. |
| **1 Month GBP-LIBOR-Index** | Der 1 Month GBP LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. |
| **1 Month NIBOR Rate Index** | Der 1 Month NIBOR (Norwegian Interbank Offered Rate) Index ist ein durchschnittlicher Zinssatz, der von der Norges Bank bestimmt wird. Er leitet sich vom Zinssatz eines vergleichbaren Darlehens am US-Dollarmarkt zuzüglich des Zinssatzdifferentials zwischen der norwegischen Krone und dem US-Dollar am Devisenterminmarkt ab. |
| **1 Month SEK LIBOR Index** | Der 1 Month SEK LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. |
| **1 Month USD LIBOR Index** | Der 1 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. |
| **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** | 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 Industries-schuldverschreibungen 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 Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2%-Deckelung entsprechend proportional. Vor dem 25. September 2009 waren die ICE BofA Merrill Lynch-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt. Der JPMorgan EMBI Global (USD Hedged) bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht anlegen. |
| **3 Month Euribor** | Der 3-Monats-Euribor (Euro Interbank Offered Rate) ist ein täglicher Referenzzinssatz auf der Basis der Zinssätze, zu denen sich Banken untereinander im Großhandel (auf dem sog. „Interbankenmarkt") unbesicherte Darlehen anbieten. |
| **3 Month GBP-LIBOR-Index** | Der 3 Month GBP LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. |
| **3 Month HIBOR Index** | Der 3 Month HIBOR (Hong Kong Interbank Offered Rate) Index ist ein Referenzzinssatz, der den durchschnittlichen Zinssatz abbildet, zu dem eine Reihe von Banken, die von der Hong Kong Association of Banks bestimmt wurden, bereit sind, sich untereinander für einen festgelegten Zeitraum auf Hongkong-Dollar lautende Instrumente zu leihen. |
| **3 Month SGD LIBOR Index** | Der 3 Month SGD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. |
| **3 Month USD LIBOR Index** | Der 3 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht anlegen. |

# Beschreibungen der Vergleichsindizes (Fortsetzung)

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **45 % Bloomberg Barclays Global Inflation Linked 1-30 Year Index (USD Hedged), 15 % Bloomberg Barclays Emerging Market Government Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged), 10 % Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (USD Unhedged), 15 % Alerian MLP Total Return Index, 5 % Bloomberg Gold Subindex Total Return** | Der Vergleichsindex 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. |
| **60 % MSCI All Country World Index / 40 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged** | Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 60 % MSCI All Country World Index/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. |
| **75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World Index** | Der Vergleichsindex ist eine Mischung bestehend aus 75 % Bloomberg Barclays Global Aggregate USD Hedged/25 % MSCI World 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 die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrieländern. Der MSCI World Index besteht aus 23 Industrieländerindizes. |
| **Alerian MLP Index** | Der Alerian MLP Index ist der führende Maßstab für Master Limited Partnership (MLPs) aus dem Energiesektor mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung. Es handelt sich um einen um Streubesitz bereinigten, marktkapitalisierungsgewichteten Index, der 50 führende Unternehmen umfasst. |
| **Bloomberg AusBond Bank Bills Index** | Der Bloomberg AusBond Bank Bills Index ist ein nicht verwalteter Index, der die Gesamtertragsleistung australischer Geldmarktpapiere abbildet. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht anlegen. |
| **Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index** | Der Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index repräsentiert die Euro Aggregate 1-10-Jahreskomponente des Bloomberg Barclays Pan-European Aggregate Index. Der Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 17 eigenstaatlichen Länder ausgegeben wurden, die an der Europäischen Währungsunion (EWU) teilnehmen. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. |
| **Bloomberg Barclays Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index** | Bloomberg Barclays Euro Aggregate ex Treasury 1-3 Year Index ist die 1 - 3-jährige Komponente des Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Index ex Treasuries. Der Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Index besteht aus Anleihen, die in Euro oder den Euro-Vorgängerwährungen der 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. |
| **Bloomberg Barclays Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index** | Der Bloomberg Barclays Euro Government (Deutschland, Frankreich, Niederlande) +15 Jahre Index repräsentiert Staatsanleihen aus Deutschland, Frankreich und den Niederlanden mit einer Laufzeit von über 15 Jahren und ist Komponente des Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Index. Dieser besteht wiederum aus Anleihen, die in Euro oder Altwährungen von 17 Mitgliedstaaten der Europäischen Währungsunion (EWU) begeben wurden. Bei allen Emissionen muss es sich um festverzinsliche Wertpapiere der Kategorie Investment Grade mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr handeln. Der Euro-Aggregate Index schließt wandelbare Wertpapiere, variabel verzinsliche Wechsel, Annuitätswechsel, Optionsscheine, gebundene Anleihen und strukturierte Produkte aus. Deutsche Schuldscheine (Quasi-Darlehens-Papiere) sind aufgrund ihrer Handelsbeschränkungen und ihres nicht notierten Status, der zu Illiquidität führt, ebenfalls ausgeschlossen. Das Emissionsland zählt nicht zu den Indexkriterien, und Wertpapiere von Emittenten außerhalb der Eurozone sind inbegriffen, wenn sie die Indexkriterien erfüllen. |

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index** | Der Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Credit Index ist die Anleihekomponente 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. |
| **Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index** | Der Bloomberg Barclays Global Aggregate (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die drei Hauptkomponenten dieses Index sind der U.S. Aggregate Index, der Pan-European Aggregate Index sowie der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Staatsanleihen und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. |
| **Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (USD Hedged)** | 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 verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. |
| **Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit Index (USD Hedged)** | 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 verbriefte Wertpapiere aus. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen, kanadische Wertpapiere und US-Dollar-144A-Wertpapiere der Kategorie Investment Grade. |
| **Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index** | Der Bloomberg Barclays Global Aggregate ex-USD (USD Hedged) Index bietet ein weites Vergleichsspektrum der internationalen Rentenmärkte der Kategorie Investment Grade. Die beiden Hauptkomponenten dieses Index sind der Pan-European Aggregate und der Asian-Pacific Aggregate Index. Des Weiteren beinhaltet der Index Eurodollar- sowie Euro-Yen-Industrieschuldverschreibungen sowie kanadische Staats-, Agency- und Unternehmenspapiere. |
| **Bloomberg Barclays US Aggregate Index** | Der Bloomberg Barclays US 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. |
| **Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index** | Der Bloomberg Barclays U.S. Aggregate 1-3 Years Index bildet Wertpapiere ab, die bei der SEC registriert und steuerpflichtig sind, auf US-Dollar lauten und eine Laufzeit zwischen 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. |
| **Bloomberg Barclays US Credit Index** | Bei dem Bloomberg Barclays US Credit Index handelt es sich um einen nicht gemanagten Index, der aus öffentlich begebenen Schuldverschreibungen von Unternehmen und spezifische Nicht-US-Schuldverschreibungen sowie besicherte Schuldverschreibungen umfasst, die die spezifizierten Anforderungen in Bezug auf Laufzeit, Liquidität und Qualität erfüllen. 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. |
| **Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index** | Der Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond USD Hedged Index misst die Wertentwicklung der führenden Märkte für inflationsgekoppelte Staatsanleihen. Der Index umfasst von den folgenden Ländern emittierte, inflationsgekoppelte Schuldtitel: Australien, Kanada, Frankreich, Schweden, Großbritannien und die USA. |
| **Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (USD Hedged)** | 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. |
| **Bloomberg Commodity Index Total Return** | Der Bloomberg Commodity Index Total Return ist ein nicht verwalteter Index aus Terminkontrakten auf eine Reihe physischer Rohstoffe. Der Index wurde als hoch liquider und diversifizierter Vergleichsindex für Rohstoffe als Vermögensklasse geschaffen. |
| **FTSE 3-Month US Treasury Bill Index** | Bei dem FTSE 3-Month US 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. |
| **FTSE Euro Broad Investment- Grade Index** | Bei dem FTSE Euro Broad Investment Grade Index handelt es sich um einen Index des auf Euro basierenden Rentenmarkts der Kategorie Investment Grade, der institutionellen Anlegern (in Euro) zugänglich ist. |

# Beschreibungen der Vergleichsindizes (Fortsetzung)

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **Gleichgewichtete Mischung von drei Indizes mit einer konstanten Duration von 0,25 Jahren, wie von PIMCO berechnet: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, USD Hedged; ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, USD Hedged; und JPMorgan EMBI Global, USD Hedged** | Der Index stellt eine gleichgewichtete Mischung aus den folgenden drei Indizes bei konstanter Duration von 0,25 Jahren dar: Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, JPMorgan EMBI Global; All USD Hedged. Der Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit ex Emerging Markets Index bietet ein breites Vergleichsspektrum der globalen erstklassigen Festzinsmärkte unter Ausschluss der Schwellenmärkte. Der ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Anleihen 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 Gesamtallokation für einen einzelnen Emittenten (vorgegeben durch Bloomberg Tickers) unter 2 % liegen muss. Emittenten mit einem Anteil über dem Schwellenwert werden auf 2 % reduziert, und der Nennwert jeder einzelnen ihrer Anleihen wird proportional angepasst. Ebenso erhöht sich der Nennwert von Anleihen aller sonstigen Emittenten unter der 2%-Deckelung entsprechend proportional. Vor dem 25. September 2009 waren die ICE BofA Merrill Lynch-Indizes als Merrill-Lynch-Indizes bekannt. Der JPMorgan EMBI Global bildet die absoluten Renditen der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden, darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. Dieser Index bildet lediglich eine bestimmte Region oder ein bestimmtes Land ab. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **ICE BofAML 3 Month USD LIBOR Index Hedged BRL Denominated in USD** | Der ICE BofAML 3 Month USD LIBOR (London Interbank Offered Rate) Index Hedged BRL Denominated in USD ist ein von der ICE Benchmark Administration bestimmter durchschnittlicher Zinssatz, den sich die Banken gegenseitig für die Nutzung kurzfristiger Geldmittel (3 Monate) auf Englands Eurodollar-Markt berechnen. In einen nicht gemanagten Index kann man nicht anlegen. |
| **ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year US Treasury Index** | 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. |
| **ICE BofA Merrill Lynch 3-Month US Treasury Bill Index (EUR Hedged)** | Der ICE BofA Merrill Lynch 3-Month US Treasury Bill Index (EUR Hedged) umfasst eine einzige Emission, die zu Monatsbeginn gekauft und für einen vollen Monat gehalten wird. Am Monatsende wird diese Emission verkauft und in eine neu ausgewählte Emission angelegt. Die bei der Neugewichtung am Monatsende jeweils gewählte Emission ist der ausstehende Schatzwechsel, dessen Fälligkeitstermin am nächsten am Datum der Neugewichtung liegt, wobei er jedoch nicht mehr als drei Monate nach diesem Datum liegen darf. Um für die Wahl berücksichtigt zu werden, muss eine Emission am oder vor dem Neugewichtungsdatum am Monatsende abgewickelt worden sein. Der Index hält zwar oft den im Rahmen der jüngsten 3-Monats-Auktion ausgegebenen Schatzwechsel, es kann jedoch auch ein älterer 6-Monats-Wechsel gewählt werden. |
| **ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD** | Der ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index Hedged into USD bildet die Wertentwicklung von Anleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade der Emittenten von Industrieschuldverschreibungen nach, die ihren Firmensitz in Industrieländern haben, die über eine erstklassige Bewertung ausländischer langfristiger Währungsverbindlichkeiten 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. |
| **ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index** | Der ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index besteht aus auf Pfund Sterling lautenden Anleihen der Kategorie Investment Grade; ausgenommen sind auf Sterling lautende, von der britischen Regierung begebene Anleihen. Alle im Index vertretenen Anleihen müssen von mindestens einer der großen Ratingagenturen als Anlagen von Investment-Grade eingestuft werden. |
| **ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index** | Der ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index bildet die Wertentwicklung von auf Pfund Sterling lautenden erstklassigen öffentlichen Schuldtiteln von Unternehmens- und quasistaatlichen Emittenten sowie Emittenten außerhalb von Großbritannien ab. |
| **ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index** | Der ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index bildet die Wertentwicklung von auf US-Dollar lautenden Unternehmensanleihen mit einer schlechteren Einstufung als Investment Grade ab, die am US-Inlandsmarkt öffentlich emittiert werden. Um für eine Aufnahme in den Index in Frage zu kommen, müssen Wertpapiere über ein Rating unterhalb von Investment Grade (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch) und ein Risikoland mit Investment Grade-Rating (basierend auf dem Durchschnitt von Moody's, S&P sowie Fitch für auf Fremdwährung lautende Staatsanleihen mit langer Laufzeit) verfügen. |
| **JPMorgan EMBI Global (EUR Unhedged)** | Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (EUR Unhedged) bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden: darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen sowie lokale Marktinstrumente. Vor dem 1. Dezember 2009 wurden die Indexrenditen von PIMCO abgesichert |
| **JPMorgan Asia Credit Index** | Der JPMorgan Asia Credit Index (JACI) misst die Wertentwicklung des asiatischen Marktes für auf USD lautende Anleihen ohne Japan. Der Index bietet einen Vergleichsindex für Anlagemöglichkeiten in fest und variabel verzinsten auf US-Dollar lautenden Anleihen von asiatischen Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen zuzüglich 10 % 1 Month USD-LIBOR. |

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)** | Bei dem JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) handelt es sich um eine besondere, gewichtete Version des CEMBI-Index. Er beschränkt den Anteil der Indexländer mit umfangreicheren Industrieschuldverschreibungen, indem er nur einen bestimmten Anteil des aktuell bankfähigen Nennwerts der Schulden dieser Länder einbezieht. Der CEMBI Diversified führt zu gut verteilten, ausgeglicheneren Gewichtungen für die im Index enthaltenen Länder. Die vom CEMBI Diversified abgedeckten Länder sind mit den vom CEMBI abgedeckten identisch. |
| **JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged)** | Der JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (Unhedged) bildet die Gesamterträge für auf lokale Währungen lautende Geldmarktinstrumente in 22 Schwellenmarktländern mit mindestens 10 Milliarden USD Außenhandel nach. |
| **JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global** | Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden: darunter verbriefte Forderungen aus Umschuldungen, Darlehen, Euro-Anleihen. |
| **JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter** | Der JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global bereinigt um den Socially Responsible Investment (SRI) Filter, bildet die Gesamterträge der auf US-Dollar lautenden Schuldinstrumente ab, die von staatlichen sowie quasi-staatlichen Körperschaften aus Schwellenländern ausgegeben wurden: darunter verbriefte Forderungen, Darlehen, Euroanleihen und lokale Marktinstrumente; ausgeschlossen sind Emittenten, die der SRI-Berater nicht zulässt. |
| **JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged)** | Der JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (Unhedged) ist ein umfassender, internationaler lokaler Schwellenmarktindex, der aus regelmäßig gehandelten, liquiden, festverzinslichen, auf Inlandswährungen lautenden Staatsanleihen besteht, an denen sich ausländische Anleger beteiligen können. |
| **JP Morgan JACI Non-Investment Grade** | Der JACI Non-IG umfasst festverzinsliche, auf US-Dollar lautende hochverzinsliche Anleihen, die von Staaten, quasi-staatlichen Stellen, Banken und Unternehmen in Asien begeben wurden. Der bestehende JACI Non-IG enthält sowohl fest- als auch variabel verzinsliche Anleihen, die von in Asien ansässigen Körperschaften begeben wurden und einen ausstehenden Nennbetrag von mindestens 150 Mio. USD sowie eine Restlaufzeit von mehr als einem Jahr aufweisen. |
| **MSCI Emerging Markets Index** | Der MSCI Emerging Markets Index ist ein um Streubesitz bereinigter Marktkapitalisierungsindex, der dazu gedacht ist, die Aktienmarktwertentwicklung von Schwellenmärkten zu messen. In einen Index kann man nicht direkt anlegen. |
| **MSCI Europe Index** | Der MSCI Europe Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte der europäischen Industrieländer zu messen. Seit Juni 2007 besteht der MSCI Europe Index aus 16 Industrieländerindizes. Der Index bildet die nicht abgesicherte Wertentwicklung der in ihm enthaltenen Aktien in Euro ab. |
| **MSCI World Index** | Der MSCI World Index ist ein um Streubesitz bereinigter, marktkapitalisierungsgewichteter Index, der dazu gedacht ist, die Wertentwicklung der Aktienmärkte in Industrieländern zu messen. Der MSCI World Index besteht aus 23 Industrieländerindizes. |
| **OECD CPI + 3 % (3 Month Lag)** | Die OECD CPI +3 % (3 Month Lag) Benchmark entsteht, indem der jährlichen prozentualen Änderung des Consumer Price Index („CPI“) für 34 OECD-Mitgliedsländer 3 % hinzugerechnet werden. Der OECD Consumer Price Index ist ein unverwalteter Index, der eine Gesamtinflationsrate von Verbraucherpreisen von 34 Ländern verkörpert, wie von der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung festgelegt. Es ist keine Garantie dafür vorhanden, dass der OECD CPI oder andere Indizes die genaue Inflationsrate wiedergeben. |
| **PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close)** | Der PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (London Close) ist ein diversifizierter globaler Index, der ein breites Spektrum von Gelegenheiten bei internationalen Rentenpapieren und Sektoren, von Industrieländern zu Schwellenmärkten, nominalem zu realem Vermögen, sowie von Barmitteln zu derivativen Instrumenten abdeckt. Abweichend von den herkömmlichen Indizes, die häufig aus Anleihen bestehen, die entsprechend ihrer Marktkapitalisierung gewertet werden, verwendet der GLADI eine BIP-Gewichtung, die sich auf schneller wachsende Gebiete der Welt konzentriert und so dem Index einen auf die Zukunft ausgerichteten Charakter verleiht. PIMCOs GLADI-Methode ist geistiges Eigentum, das durch das US-Patent Nr. 8.306.892 geschützt ist. GLOBAL ADVANTAGE und GLADI sind Markenzeichen von Pacific Investment Management Company LLC. |
| **PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged)** | Der PIMCO Global Advantage Inflation-Linked Bond Index (USD Unhedged) repräsentiert den internationalen Rentenmarkt für inflationsgekoppelte Staatsanleihen, sowohl für Industrie- als auch Schwellenländer. Der Index berücksichtigt die Prinzipien der PIMCO Global Advantage Indizes, sofern diese auf den internationalen Markt für inflationsgekoppelte Anleihen anwendbar sind. |
| **RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Index** | Die Strategie des RAFI Dynamic Multi-Factor EM Index richtet zeitvariable Engagements gegenüber vier Renditefaktoren ein: Wert, niedrige Volatilität, Qualität und Momentum. Der Index verwendet aktuelle und historische Kennzahlen, um sich an Faktorportfolios auszurichten, die auf zukunftsorientierter Basis besonders attraktiv sind. |
| **RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Index** | Der RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Index besteht aus „Faktorportfolios“ mit europäischen Aktien, die einen Schwerpunkt auf die folgenden fünf Faktoren setzen: Wert, niedrige Volatilität, Qualität, Momentum und Größe. Der Faktor „Wert“ stellt Unternehmen in den Vordergrund, deren Fundamentalgewichtung im Verhältnis zu ihrer Marktkapitalisierungsgewichtung hoch ist. Der Faktor „niedrige Volatilität“ konzentriert sich auf Unternehmen mit niedrigen Risikokennzahlen. Diese werden als die Varianz der täglichen Überschussrenditen eines Unternehmens über einen Zeitraum von fünf Jahren berechnet und leiten sich von globalen, lokalen Ländergruppen und globalen Branchen-Überschussrenditen ab. Der Faktor „Qualität“ hebt Unternehmen hervor, die eine hohe Rentabilität und niedrige Investitionsausgaben aufweisen. Der Faktor „Momentum“ konzentriert sich auf Aktien mit hoher Kursdynamik. Beim Faktor „Größe“ handelt es sich um die Gleichgewichtung der auf Kleinunternehmen entfallenden Anteile der übrigen vier Faktoren. Renditen werden nach Abzug von Quellensteuern berechnet. |

## Beschreibungen der Vergleichsindizes (Fortsetzung)

| Offizieller Name des Vergleichsindex | Beschreibung des Index |
|---|---|
| **RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Index** | Der RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Index besteht aus „Faktorportfolios“ mit Aktien aus Industrieländern, die einen Schwerpunkt auf die folgenden fünf Faktoren setzen: Wert, niedrige Volatilität, Qualität, Momentum und Größe. Der Faktor „Wert“ stellt Unternehmen in den Vordergrund, deren Fundamentalgewichtung im Verhältnis zu ihrer Marktkapitalisierungsgewichtung hoch ist. Der Faktor „niedrige Volatilität“ konzentriert sich auf Unternehmen mit niedrigen Risikokennzahlen. Diese werden als die Varianz der täglichen Überschussrenditen eines Unternehmens über einen Zeitraum von fünf Jahren berechnet und leiten sich von globalen, lokalen Ländergruppen und globalen Branchen-Überschussrenditen ab. Der Faktor „Qualität“ hebt Unternehmen hervor, die eine hohe Rentabilität und niedrige Investitionsausgaben aufweisen. Der Faktor „Momentum“ konzentriert sich auf Aktien mit hoher Kursdynamik. Beim Faktor „Größe“ handelt es sich um die Gleichgewichtung der auf Kleinunternehmen entfallenden Anteile der übrigen vier Faktoren. Renditen werden nach Abzug von Quellensteuern berechnet. |
| **RAFI Dynamic Multi-Factor US Net TR Index** | Der RAFI Dynamic Multi-Factor US Net TR Index besteht aus „Faktorportfolios“ mit US-Aktien, die einen Schwerpunkt auf die folgenden fünf Faktoren setzen: Wert, niedrige Volatilität, Qualität, Momentum und Größe. Der Faktor „Wert“ stellt Unternehmen in den Vordergrund, deren Fundamentalgewichtung im Verhältnis zu ihrer Marktkapitalisierungsgewichtung hoch ist. Der Faktor „niedrige Volatilität“ konzentriert sich auf Unternehmen mit niedrigen Risikokennzahlen. Diese werden als die Varianz der täglichen Überschussrenditen eines Unternehmens über einen Zeitraum von fünf Jahren berechnet und leiten sich von globalen, lokalen Ländergruppen und globalen Branchen-Überschussrenditen ab. Der Faktor „Qualität“ hebt Unternehmen hervor, die eine hohe Rentabilität und niedrige Investitionsausgaben aufweisen. Der Faktor „Momentum“ konzentriert sich auf Aktien mit hoher Kursdynamik. Beim Faktor „Größe“ handelt es sich um die Gleichgewichtung der auf Kleinunternehmen entfallenden Anteile der übrigen vier Faktoren. Renditen werden nach Abzug von Quellensteuern berechnet. |
| **S&P 500 Index** | Der S&P 500 Index 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. |

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

# Finanzstatus

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Asia High Yield Bond Fund[1] Zum 30. Juni 2019 | PIMCO Capital Securities Fund Zum 30. Juni 2019 | PIMCO Capital Securities Fund Zum 31. Dez. 2018 |
|---|---|---|---|
| **Aktiva:** | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 139.898 | $ 7.736.255 | $ 7.574.716 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 0 |
| Finanzderivate | 118 | 94.984 | 38.839 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 0 | 0 | 3.510 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 441 | 138.156 | 105.870 |
| Forderungen aus Einkünften | 2.130 | 68.469 | 56.707 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 2.792 | 67 | 0 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 0 | 11.505 | 3.299 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 171 | 33.258 | 3.844 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 145.550 | 8.082.694 | 7.786.785 |
| **Passiva:** | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | |
| Finanzderivate | (850) | (102.739) | (53.891) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (598) | (26.276) | (651.096) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | 0 | (41.074) | (9.810) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (10) | (5.219) | (5.239) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | (903.337) | (1.043.568) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (3) | (296) | (664) |
| Überziehungskredit | (2.879) | (75.439) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | 0 | (70.315) | (23.789) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (4.340) | (1.224.695) | (1.788.057) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 141.210 | $ 6.857.999 | $ 5.998.728 |

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

(1) Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund wurde am 14. Februar 2019 aufgelegt.

| | Commodity Real Return Fund | | PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | | Diversified Income Fund | | Diversified Income Duration Hedged Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| | $ 827.319 | $ 905.764 | $ 143.317 | $ 140.799 | $ 8.959.712 | $ 7.144.936 | $ 1.426.127 | $ 1.306.321 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 18.996 | 4.020 | 3.631 | 1.537 | 175.985 | 75.139 | 21.721 | 4.935 |
| | 1.236 | 1.234 | 0 | 451 | 24.924 | 4.291 | 7.511 | 3.917 |
| | 7.350 | 24.596 | 1.340 | 1.496 | 181.430 | 184.842 | 41.758 | 43.745 |
| | 2.791 | 2.000 | 1.189 | 1.464 | 80.533 | 75.957 | 13.561 | 14.086 |
| | 61 | 82 | 1.396 | 98 | 11.701 | 2.757 | 1.894 | 549 |
| | 175.402 | 66.310 | 1.509 | 0 | 755.036 | 207.759 | 170.437 | 74.445 |
| | 1.473 | 196 | 89 | 81 | 43.180 | 9.025 | 632 | 738 |
| | 5.836 | 4.017 | 596 | 511 | 0 | 0 | 22.140 | 14.503 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 1.040.464 | 1.008.219 | 153.067 | 146.437 | 10.232.501 | 7.704.706 | 1.705.781 | 1.463.239 |
| | (13.530) | (34.207) | (2.010) | (1.562) | (59.733) | (68.731) | (35.725) | (21.537) |
| | (12.698) | (6.434) | (504) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (6.294) | 0 | 0 | (2.429) | (67.767) | (159.929) | (11.466) | (4.963) |
| | (264.327) | (151.281) | (1.007) | 0 | (1.344.891) | (608.944) | (267.266) | (158.489) |
| | (664) | (461) | (533) | (559) | (3.696) | (8.756) | (5.091) | (729) |
| | (395) | (431) | (138) | (144) | (7.076) | (5.929) | (1.047) | (1.043) |
| | (186.674) | (287.175) | 0 | 0 | 0 | (10.122) | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (4) | (6) | 0 | (7) | (396) | (569) | (238) | (272) |
| | 0 | 0 | (142) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | (53.639) | (454) | 0 | 0 |
| | (18.264) | (7.132) | (1.673) | (150) | (55.627) | (22.237) | (11.232) | (2.296) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (502.850 ) | (487.127) | (6.007) | (4.851) | (1.592.825) | (885.671) | (332.065) | (189.329) |
| | $ 537.614 | $ 521.092 | $ 147.060 | $ 141.586 | $ 8.639.676 | $ 6.819.035 | $ 1.373.716 | $ 1.273.910 |

## Finanzstatus (Fortsetzung)

| (Angaben in Tausend) | Dynamic Bond Fund | | Dynamic Multi-Asset Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 4.059.403 | $ 3.968.292 | € 1.317.453 | € 1.142.233 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 5.506 | 5.503 | 8.010 | 0 |
| Finanzderivate | 74.142 | 44.120 | 19.026 | 15.211 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 6.738 | 4.396 | 6.778 | 5.490 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 71.970 | 65.643 | 25.974 | 41.416 |
| Forderungen aus Einkünften | 21.452 | 16.358 | 3.502 | 6.178 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 832 | 63 | 33 | 259 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 707.868 | 533.729 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 92.197 | 2.455 | 8.421 | 1.438 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 60.502 | 6.769 | 0 | 0 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 5.100.610 | 4.647.328 | 1.389.197 | 1.212.225 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (107.541) | (55.095) | (9.984) | (15.949) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (28.519) | (19.604) | (16.199) | (3.790) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (925.104) | (1.241.701) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (11.170) | (2.505) | (822) | (938) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (2.988) | (2.553) | (1.343) | (1.266) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (5.797) | (219.618) | 0 | 0 |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (47) | (172) | (3) | (4) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | (3.825) | (458) |
| Einlagen von Kontrahenten | (33.662) | (18.935) | (7.427) | (1.856) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (1.114.828) | (1.560.183) | (39.603) | (24.261) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 3.985.782 | $ 3.087.145 | € 1.349.594 | € 1.187.964 |

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

| Emerging Asia Bond Fund | | Emerging Local Bond Fund | | Emerging Markets Bond Fund | | Emerging Markets Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| $ 36.129 | $ 33.146 | $ 3.131.994 | $ 2.506.263 | $ 3.685.879 | $ 2.372.828 | $ 232.244 | $ 201.245 |
| 0 | 0 | 0 | 7.304 | 8.008 | 8.005 | 0 | 0 |
| 126 | 91 | 132.584 | 49.563 | 65.658 | 18.107 | 5.180 | 1.669 |
| 0 | 55 | 0 | 6.576 | 935 | 4.681 | 0 | 1.006 |
| 67 | 70 | 29.415 | 30.201 | 37.060 | 37.631 | 1.259 | 594 |
| 430 | 383 | 56.052 | 38.443 | 53.108 | 35.217 | 3.340 | 3.113 |
| 0 | 0 | 85.938 | 43.880 | 19.388 | 209 | 0 | 1.196 |
| 0 | 0 | 279.491 | 75.143 | 1.057 | 1.047 | 0 | 0 |
| 4 | 0 | 2.453 | 32.915 | 5.786 | 3.335 | 597 | 119 |
| 0 | 26 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 36.756 | 33.771 | 3.717.927 | 2.790.288 | 3.876.879 | 2.481.060 | 242.620 | 208.942 |
| (256) | (117) | (86.255) | (45.910) | (12.901) | (9.751) | (1.234) | (416) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (1.057) | (1.047) | 0 | 0 |
| (198) | 0 | (27.025) | (69.082) | (8.264) | (22.000) | (2.091) | (1.740) |
| 0 | 0 | (551.978) | (339.345) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (66) | (43) | (1.144) | (32.722) | (20.089) | (2.125) | (48) | (111) |
| (44) | (42) | (1.944) | (1.844) | (2.690) | (1.881) | (236) | (210) |
| 0 | 0 | (425.979) | 0 | (23.521) | 0 | (1.214) | (11.305) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (779) | (116) | (7.955) | (7.956) | 0 | 0 |
| (556) | 0 | (92.773) | 0 | 0 | 0 | (279) | 0 |
| (28) | 0 | (13.638) | (1.990) | (3.770) | (393) | (887) | (552) |
| 0 | 0 | (41.307) | (17.895) | (44.711) | (7.617) | (2.355) | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1.148 ) | (202) | (1.242.822) | (508.904) | (124.958) | (52.770) | (8.344) | (14.334) |
| $ 35.608 | $ 33.569 | $ 2.475.105 | $ 2.281.384 | $ 3.751.921 | $ 2.428.290 | $ 234.276 | $ 194.608 |

# Finanzstatus (Fortsetzung)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund[2] Zum 30. Juni 2019 | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
|---|---|---|---|
| **Aktiva:** | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 123.054 | $ 68.381 | $ 50.626 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 200 | 200 |
| Finanzderivate | 2.280 | 1.926 | 940 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 0 | 117 | 397 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 5.187 | 292 | 350 |
| Forderungen aus Einkünften | 1.267 | 690 | 313 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 2.991 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 305 | 254 | 19 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 0 | 353 | 29 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 135.084 | 72.213 | 52.874 |
| **Passiva:** | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | |
| Finanzderivate | (596) | (1.055) | (971) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (3.081) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | 0 | (103) | (47) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (74) | (69) | (57) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | 0 | 0 |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | 0 | 0 | 0 |
| Überziehungskredit | (1.987) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (559) | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (350) | (650) | 0 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (6.647) | (1.877) | (1.075) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 128.437 | $ 70.336 | $ 51.799 |

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

[2] Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund wurde am 04. Juni 2019 aufgelegt.

| | Euro Bond Fund | | Euro Credit Fund | | Euro Income Bond Fund | | Euro Long Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| | € 2.678.585 | € 2.083.868 | € 1.026.222 | € 772.012 | € 2.524.005 | € 1.533.049 | € 311.155 | € 266.832 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 42.018 | 24.307 | 11.624 | 4.720 | 19.385 | 8.586 | 5.396 | 5.474 |
| | 8.135 | 10.681 | 4.141 | 1.206 | 18.671 | 873 | 841 | 1.710 |
| | 29.729 | 29.516 | 19.242 | 15.892 | 45.421 | 43.383 | 5.382 | 5.268 |
| | 9.273 | 9.510 | 6.235 | 6.057 | 16.208 | 14.932 | 922 | 1.968 |
| | 1.994 | 108 | 16 | 16 | 1.385 | 1.288 | 7 | 7 |
| | 316.548 | 53.758 | 98.256 | 17.209 | 420.524 | 54.355 | 40.077 | 12.857 |
| | 10.317 | 7.786 | 1.997 | 474 | 16.463 | 2.003 | 23 | 0 |
| | 0 | 0 | 69 | 364 | 9.582 | 7.083 | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 3.096.599 | 2.219.534 | 1.167.802 | 817.950 | 3.071.644 | 1.665.552 | 363.803 | 294.116 |
| | (15.841) | (18.085) | (5.156) | (4.029) | (15.121) | (11.348) | (2.493) | (2.808) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (24.968) | (23.499) | (18.921) | 0 | (61.067) | (4.341) | (2.154) | (2.460) |
| | (526.284) | (186.852) | (169.238) | (64.499) | (746.994) | (150.182) | (61.331) | (30.554) |
| | (693) | (1.376) | (455) | (1.848) | (1.046) | (2.285) | (3) | 0 |
| | (991) | (781) | (348) | (306) | (1.942) | (1.494) | (106) | (94) |
| | 0 | 0 | (3.518) | (2.686) | (15.855) | 0 | (1.854) | (998) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (12) | (9) | 0 | 0 | (18) | (33) | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (16.356) | (1.591) | 0 | 0 | 0 | 0 | (3.085) | (2.293) |
| | (17.088) | (8.901) | (5.186) | (2.524) | (14.114) | (7.926) | (818) | (915) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (602.233 ) | (241.094) | (202.822) | (75.892) | (856.157) | (177.609) | (71.844) | (40.122) |
| | € 2.494.366 | € 1.978.440 | € 964.980 | € 742.058 | € 2.215.487 | € 1.487.943 | € 291.959 | € 253.994 |

## Finanzstatus (Fortsetzung)

| (Angaben in Tausend) | Euro Low Duration Fund | | Euro Short-Term Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | € 333.795 | € 309.571 | € 707.076 | € 778.345 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Finanzderivate | 1.893 | 1.652 | 3.429 | 1.254 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 1.568 | 389 | 10.214 | 476 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 707 | 2.071 | 1.830 | 1.620 |
| Forderungen aus Einkünften | 2.225 | 2.788 | 2.941 | 3.751 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 36 | 16 | 1.608 | 2.547 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 0 | 0 | 295 | 369 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 340.224 | 316.487 | 727.393 | 788.362 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (426) | (1.419) | (2.198) | (2.430) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (2.945) | 0 | (10.007) | (8.919) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (158) | 0 | (600) | (938) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (136) | (162) | (434) | (494) |
| 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 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (425) | (223) | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (857) | (741) | (1.453) | (542) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (4.947) | (2.545) | (14.692) | (13.323) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | € 335.277 | € 313.942 | € 712.701 | € 775.039 |

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

| Global Advantage Fund | | Global Advantage Real Return Fund | | Global Bond Fund | | Global Bond ESG Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| $ 1.133.009 | $ 1.032.175 | $ 106.967 | $ 128.001 | $ 17.884.344 | $ 14.172.086 | $ 838.830 | $ 628.875 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 28.385 | 28.307 | 0 | 0 |
| 30.647 | 20.999 | 3.778 | 1.926 | 390.565 | 224.258 | 22.967 | 7.046 |
| 3.025 | 3.652 | 500 | 450 | 25.935 | 19.979 | 1.514 | 1.595 |
| 12.556 | 15.840 | 1.540 | 1.682 | 238.838 | 169.366 | 7.202 | 10.453 |
| 5.835 | 5.527 | 336 | 493 | 75.563 | 59.977 | 3.909 | 2.793 |
| 5.583 | 3.849 | 127 | 115 | 515.119 | 46.129 | 3.941 | 3.747 |
| 336.894 | 118.469 | 26.502 | 18.242 | 2.799.632 | 2.487.998 | 132.119 | 47.948 |
| 146 | 27 | 30 | 21 | 72.563 | 21.604 | 253 | 1.179 |
| 8.263 | 3.426 | 0 | 159 | 29.840 | 18.979 | 2.476 | 2.575 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1.535.958 | 1.203.964 | 139.780 | 151.089 | 22.060.784 | 17.248.683 | 1.013.211 | 706.211 |
| (29.088) | (23.912) | (2.337) | (1.880) | (352.480) | (244.146) | (16.967) | (13.596) |
| 0 | 0 | (2.116) | (1.072) | (2.805) | (2.752) | 0 | 0 |
| (6.691) | (3.647) | (76) | 0 | (630.169) | (47.697) | (7.384) | (3.487) |
| (548.150) | (307.404) | (37.825) | (31.362) | (6.568.188) | (5.400.471) | (267.824) | (145.895) |
| (15.896) | (12) | 0 | (79) | (16.736) | (9.536) | (227) | (5) |
| (464) | (443) | (47) | (56) | (6.610) | (5.643) | (270) | (225) |
| (118.961) | (117.588) | (15.464) | (27.252) | (400.547) | (541.487) | (10.891) | (26.100) |
| 0 | (11.194) | (3.067) | 0 | 0 | 0 | (20.682) | (8.875) |
| (48) | (28) | (7) | (12) | (233) | (252) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | (673) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (14.876) | (7.790) | (1.021) | (1.522) | (150.745) | (96.690) | (11.470) | (1.632) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (14) |
| (734.174 ) | (472.018) | (62.633) | (63.235) | (8.128.513) | (6.348.674) | (335.715) | (199.829) |
| $ 801.784 | $ 731.946 | $ 77.147 | $ 87.854 | $ 13.932.271 | $ 10.900.009 | $ 677.496 | $ 506.382 |

## Finanzstatus (Fortsetzung)

| (Angaben in Tausend) | Global Bond Ex-US Fund | | Global High Yield Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.253.203 | $ 1.238.318 | $ 3.767.633 | $ 3.156.859 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Finanzderivate | 19.124 | 19.979 | 44.512 | 4.217 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 6.794 | 4.053 | 0 | 0 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 22.776 | 22.045 | 11.142 | 11.207 |
| Forderungen aus Einkünften | 6.088 | 6.148 | 46.197 | 47.152 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 10.960 | 4.484 | 5.425 | 0 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 230.221 | 68.671 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 106 | 579 | 34.221 | 21.523 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 15.345 | 1.903 | 0 | 4.276 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 30 | 129 |
| **Summe Aktiva** | 1.564.617 | 1.366.180 | 3.909.160 | 3.245.363 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (38.976) | (25.680) | (12.690) | (6.946) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (11.425) | (3.933) | (26.549) | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (413.239) | (234.644) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (35) | (5.492) | (28.408) | (12.020) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (581) | (592) | (2.260) | (2.078) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (110.732) | (99.537) | (26.462) | (66.384) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (14.159) | (27.323) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (8) | (9) | (75) | (147) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | (4.347) | (761) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | (434) | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (8.487) | (5.745) | (24.629) | (3.155) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | (13) | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (597.642) | (402.955) | (125.867) | (91.491) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 966.975 | $ 963.225 | $ 3.783.293 | $ 3.153.872 |

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

| | Global Investment Grade Credit Fund | | Global Investment Grade Credit ESG Fund | | Global Libor Plus Bond Fund | | Global Low Duration Real Return Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| | $ 22.560.769 | $ 19.519.036 | $ 82.133 | $ 51.486 | $ 1.637.330 | $ 1.268.011 | $ 1.702.886 | $ 1.788.929 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 387.421 | 188.134 | 1.336 | 257 | 18.432 | 6.871 | 22.899 | 16.194 |
| | 41.402 | 29.463 | 0 | 245 | 10.022 | 2.136 | 4.983 | 6.375 |
| | 331.934 | 294.358 | 337 | 193 | 27.728 | 19.390 | 14.756 | 19.908 |
| | 198.584 | 182.873 | 562 | 323 | 9.010 | 5.366 | 5.983 | 5.193 |
| | 37.398 | 7.808 | 0 | 211 | 9 | 72 | 246.637 | 15.599 |
| | 1.392.708 | 1.348.041 | 7.795 | 1.621 | 218.115 | 132.666 | 370.717 | 217.601 |
| | 59.018 | 28.971 | 54 | 0 | 5.893 | 7.115 | 538 | 416 |
| | 73.754 | 13.525 | 298 | 40 | 25.208 | 5.963 | 11.158 | 7.548 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 452 | 0 |
| | 25.082.988 | 21.612.209 | 92.515 | 54.376 | 1.951.747 | 1.447.590 | 2.381.009 | 2.077.763 |
| | (280.658) | (152.920) | (552) | (167) | (39.971) | (16.188) | (26.629) | (20.843) |
| | 0 | (28.009) | 0 | 0 | 0 | 0 | (49.785) | (35.482) |
| | (146.914) | (44.660) | (1.440) | (3.849) | (27.409) | (2.485) | (5.679) | 0 |
| | (3.638.355) | (2.460.345) | (15.545) | (7.019) | (311.087) | (385.570) | (542.918) | (435.734) |
| | (39.830) | (29.992) | (2) | 0 | (174) | (171) | (1.569) | (881) |
| | (9.623) | (8.866) | (29) | (11) | (601) | (376) | (549) | (613) |
| | (774.581) | (1.554.842) | (207) | (599) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (619.399) | (420.442) |
| | (714) | (485) | 0 | 0 | (4) | (2) | (2) | (2) |
| | 0 | 0 | (121) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (243.165) | (87.954) | (850) | 0 | (4.083) | (3.288) | (14.843) | (9.492) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (12) | 0 | 0 |
| | (5.133.840 ) | (4.368.073) | (18.746) | (11.645) | (383.329) | (408.092) | (1.261.373) | (923.489) |
| | $ 19.949.148 | $ 17.244.136 | $ 73.769 | $ 42.731 | $ 1.568.418 | $ 1.039.498 | $ 1.119.636 | $ 1.154.274 |

## Finanzstatus (Fortsetzung)

| (Angaben in Tausend) | Global Multi-Asset Fund | | Global Real Return Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.353.099 | $ 1.481.231 | $ 2.891.858 | $ 2.824.388 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Finanzderivate | 29.789 | 24.504 | 33.375 | 24.308 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 7.200 | 6.287 | 5.208 | 8.490 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 33.819 | 34.746 | 23.507 | 28.769 |
| Forderungen aus Einkünften | 2.646 | 3.536 | 7.649 | 8.783 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 396 | 7.943 | 402 | 467 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 689.479 | 618.985 | 510.415 | 413.337 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 1.542 | 16.563 | 1.753 | 2.230 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 3.956 | 13.986 | 18.350 | 8.637 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 2.121.926 | 2.207.781 | 3.492.517 | 3.319.409 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (27.646) | (34.987) | (47.280) | (31.356) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | (78.406) | (67.065) | (62.886) | (40.356) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (24.684) | (808) | (9.478) | (125) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (974.528) | (932.390) | (817.917) | (726.400) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (559) | (32.576) | (2.423) | (2.226) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (834) | (861) | (1.118) | (1.125) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (138.415) | (270.761) | (417.318) | (549.427) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | (2.496) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (8) | (29) | (48) | (56) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (14.249) | (15.385) | (33.044) | (20.768) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (1.259.329) | (1.357.358) | (1.391.512) | (1.371.839) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 862.597 | $ 850.423 | $ 2.101.005 | $ 1.947.570 |

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

| | Income Fund | | Inflation Strategy Fund | | Low Average Duration Fund | | Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| | $ 87.015.442 | $ 70.615.260 | $ 122.132 | $ 111.400 | $ 1.424.842 | $ 1.667.425 | $ 630.750 | $ 558.425 |
| | 104.075 | 104.032 | 0 | 0 | 3.310 | 3.301 | 0 | 0 |
| | 1.341.837 | 904.628 | 3.480 | 2.331 | 10.596 | 16.669 | 12.401 | 3.091 |
| | 262.667 | 133.553 | 1.198 | 537 | 2.117 | 1.650 | 0 | 810 |
| | 915.109 | 1.082.334 | 2.161 | 3.263 | 8.635 | 12.013 | 5.408 | 5.017 |
| | 495.346 | 443.202 | 244 | 339 | 5.123 | 7.623 | 5.218 | 5.004 |
| | 156.063 | 51.222 | 7.407 | 205 | 3 | 272 | 2.820 | 23 |
| | 14.287.056 | 6.326.386 | 43.559 | 18.260 | 586.764 | 325.067 | 22.683 | 4.744 |
| | 401.362 | 221.593 | 14 | 27 | 4.242 | 767 | 1.025 | 250 |
| | 665.395 | 83.466 | 0 | 0 | 1.742 | 9.634 | 1.572 | 1.054 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 105.644.352 | 79.965.676 | 180.195 | 136.362 | 2.047.374 | 2.044.421 | 681.877 | 578.418 |
| | (1.446.749) | (948.936) | (2.678) | (2.777) | (9.103) | (24.902) | (5.133) | (3.379) |
| | (1.977.646) | 0 | (2.419) | (2.339) | (136.959) | (31.712) | (1.109) | 0 |
| | (311.471) | (85.092) | (2.761) | (139) | 0 | (76.084) | (2.712) | 0 |
| | (26.174.124) | (11.455.291) | (71.477) | (35.078) | (511.672) | (466.709) | (48.305) | (7.651) |
| | (265.873) | (148.615) | (20.924) | (55) | (5.851) | (928) | (309) | (339) |
| | (54.120) | (45.879) | (81) | (79) | (463) | (539) | (220) | (232) |
| | (1.482.727) | (10.937.801) | (6.277) | (18.330) | (234.612) | (212.657) | (96.558) | (36.952) |
| | 0 | 0 | (1.946) | 0 | (28.721) | 0 | 0 | (2.702) |
| | (4.774) | (4.355) | (5) | (5) | (264) | (275) | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (135) | 0 |
| | 0 | 0 | (182) | (327) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (685.261) | (421.235) | (270) | (1.052) | (4.923) | (9.325) | (9.329) | (963) |
| | (43) | (43) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (32.402.788 ) | (24.047.247) | (109.020) | (60.181) | (932.568) | (823.131) | (163.810) | (52.218) |
| | $ 73.241.564 | $ 55.918.429 | $ 71.175 | $ 76.181 | $ 1.114.806 | $ 1.221.290 | $ 518.067 | $ 526.200 |

# Finanzstatus (Fortsetzung)

| (Angaben in Tausend) | Low Duration Income Fund | | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 504.096 | $ 426.590 | $ 255.015 | $ 245.502 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 1.802 | 1.801 | 0 | 0 |
| Finanzderivate | 12.491 | 4.610 | 4.519 | 1.197 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 0 | 905 | 73 | 43 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 4.493 | 5.665 | 720 | 20.670 |
| Forderungen aus Einkünften | 2.523 | 1.850 | 96 | 23 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 59.762 | 120 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 157.343 | 74.005 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 3.075 | 10 | 18 | 116 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 6.247 | 80 | 0 | 0 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 751.832 | 515.636 | 260.441 | 267.551 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (10.549) | (4.796) | (706) | (11.309) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (713) | (621) | (37) | (7.791) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (270.624) | (129.795) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | 0 | (10) | (285) | (2.046) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (179) | (176) | (207) | (213) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (502) | 0 | 0 | 0 |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | 0 | 0 | (2) | (2) |
| Überziehungskredit | (57.784) | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (8.978) | (2.470) | (2.004) | 0 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | (9) | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (349.338) | (137.868) | (3.241) | (21.361) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 402.494 | $ 377.768 | $ 257.200 | $ 246.190 |

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

| Mortgage Opportunities Fund | | PIMCO RAE Emerging Markets Fund | | PIMCO RAE Europe Fund | | PIMCO RAE Global Developed Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| $ 3.104.843 | $ 3.637.877 | $ 116.837 | $ 93.766 | € 7.396 | € 8.061 | $ 51.278 | $ 31.608 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 41.997 | 17.858 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 15.946 | 0 | 310 | 1.133 | 149 | 118 | 376 | 464 |
| 26.629 | 36.869 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 7.554 | 8.178 | 744 | 375 | 19 | 13 | 82 | 52 |
| 1.446 | 3.172 | 183 | 4 | 0 | 0 | 42 | 0 |
| 1.472.555 | 3.041.202 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 16.239 | 4.267 | 26 | 126 | 8 | 2 | 22 | 15 |
| 37.181 | 8.521 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4.724.390 | 6.757.944 | 118.100 | 95.404 | 7.572 | 8.194 | 51.800 | 32.139 |
| (67.761) | (34.899) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (109.296) | (1.078.788) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (11.015) | (353.809) | (79) | (562) | 0 | (62) | 0 | (135) |
| (2.108.012) | (2.545.988) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (24.690) | (4.223) | (169) | 0 | (90) | 0 | (108) | (32) |
| (890) | (1.370) | (38) | (29) | (5) | (5) | (44) | (29) |
| (736.335) | (539.766) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (17.076) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (8) | (9) | (147) | (69) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (3.222) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (17.549) | (12.821) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (20) | 0 | (4) | 0 | (2) | 0 | (4) |
| (3.092.632 ) | (4.574.915) | (433) | (664) | (95) | (69) | (152) | (200) |
| $ 1.631.758 | $ 2.183.029 | $ 117.667 | $ 94.740 | € 7.477 | € 8.125 | $ 51.648 | $ 31.939 |

## Finanzstatus (Fortsetzung)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | | PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 28.093 | $ 41.732 | $ 217.170 | $ 340.485 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 0 | 400 |
| Finanzderivate | 2.148 | 1.100 | 16.858 | 6.801 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 70 | 250 | 565 | 1.900 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 582 | 1.164 | 6.044 | 12.937 |
| Forderungen aus Einkünften | 49 | 126 | 758 | 1.305 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 10 | 473 | 946 | 0 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 11.046 | 5.059 | 69.157 | 77.760 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 9 | 47 | 0 | 0 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 614 | 408 | 3.954 | 3.610 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 42.621 | 50.359 | 315.452 | 445.198 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (1.462) | (1.758) | (11.200) | (15.615) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | (106) | (105) | (846) | (837) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | 0 | (329) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (15.312) | (12.301) | (107.624) | (133.715) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (170) | (2.287) | (3) | (12) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (45) | (57) | (279) | (351) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | 0 | 0 | 0 | (46.283) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | (23.642) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | (1.152) | (130) | (10.130) | (7.185) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (18.247) | (16.967) | (130.082) | (227.640) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 24.374 | $ 33.392 | $ 185.370 | $ 217.558 |

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

(3) Der PIMCO RAE PLUS US Fund wurde am 05. Juni 2019 geschlossen.

| PIMCO RAE PLUS US Fund[3] | | PIMCO RAE US Fund | | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund | | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| $ 0 | $ 158.974 | $ 12.981 | $ 11.455 | $ 10.759 | $ 9.805 | € 4.648 | € 4.075 |
| 0 | 400 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 4.013 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 25 | 713 | 77 | 138 | 93 | 49 | 27 | 25 |
| 0 | 11.116 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 535 | 10 | 12 | 56 | 39 | 9 | 6 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 8.668 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 799 | 0 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 96 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 25 | 185.314 | 13.068 | 11.615 | 10.908 | 9.893 | 4.684 | 4.106 |
| 0 | (6.018) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (523) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (6.809) | 0 | (84) | 0 | 0 | 0 | (1) |
| 0 | (38.873) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (25) | (643) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (90) | (5) | (5) | (4) | (4) | (1) | (1) |
| 0 | (6.743) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (21) | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | (1.860) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | (1) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (25) | (61.559) | (5) | (90) | (25) | (4) | (1) | (2) |
| $ 0 | $ 123.755 | $ 13.063 | $ 11.525 | $ 10.883 | $ 9.889 | € 4.683 | € 4.104 |

## Finanzstatus (Fortsetzung)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund | | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 5.248 | $ 4.581 | $ 3.149 | $ 2.713 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Finanzderivate | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 32 | 39 | 12 | 26 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Forderungen aus Einkünften | 8 | 5 | 3 | 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 |
| **Summe Aktiva** | 5.288 | 4.625 | 3.164 | 2.743 |
| **Passiva:** | | | | |
| 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 | (15) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (2) | (2) | (1) | (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 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Einlagen von Kontrahenten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (2) | (2) | (1) | (16) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 5.286 | $ 4.623 | $ 3.163 | $ 2.727 |

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

(4) Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund wurde am 29. März 2019 aufgelegt.

| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | | StocksPLUS™ Fund | | PIMCO StocksPLUS™ AR Fund(4) | Strategic Income Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| $ 665.019 | $ 531.532 | $ 3.219.604 | $ 2.327.466 | $ 5.936 | $ 1.270.759 | $ 1.035.708 |
| 1.802 | 1.801 | 20.138 | 20.109 | 0 | 1.201 | 1.201 |
| 11.246 | 2.407 | 98.742 | 28.469 | 32 | 29.672 | 11.604 |
| 1.133 | 112 | 0 | 0 | 2 | 7.458 | 6.451 |
| 9.706 | 8.450 | 62.093 | 209.426 | 56 | 11.470 | 11.431 |
| 10.000 | 8.216 | 9.880 | 9.737 | 23 | 6.000 | 4.936 |
| 2.096 | 47 | 145 | 95 | 201 | 1.064 | 14.208 |
| 0 | 0 | 725.058 | 327.971 | 816 | 338.287 | 125.521 |
| 571 | 43 | 3.828 | 576 | 0 | 2.306 | 4.854 |
| 0 | 0 | 16.489 | 39.759 | 6 | 8.870 | 110 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 701.573 | 552.608 | 4.155.977 | 2.963.608 | 7.072 | 1.677.087 | 1.216.024 |
| (2.803) | (1.682) | (37.017) | (193.700) | (21) | (21.293) | (11.551) |
| 0 | 0 | (147.380) | (104.254) | 0 | 0 | 0 |
| (1.496) | (1.089) | (34.613) | (69.943) | (561) | (19.087) | (10.511) |
| 0 | 0 | (910.405) | (291.924) | (1.219) | (537.594) | (223.157) |
| (6.360) | (115) | (27.179) | (1.168) | 0 | (1.442) | (5.295) |
| (488) | (407) | (1.452) | (1.226) | (3) | (1.059) | (918) |
| (1.784) | 0 | (3.046) | 0 | 0 | 0 | (56.542) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (5.315) |
| (179) | (179) | (2) | (5) | 0 | (11) | (16) |
| 0 | 0 | (3.731) | (407) | 0 | 0 | 0 |
| (819) | (163) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (6.720) | (590) | (63.748) | (1.778) | 0 | (19.068) | (3.586) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (1) | (1) |
| (20.649 ) | (4.225) | (1.228.573) | (664.405) | (1.804) | (599.555) | (316.892) |
| $ 680.924 | $ 548.383 | $ 2.927.404 | $ 2.299.203 | $ 5.268 | $ 1.077.532 | $ 899.132 |

## Finanzstatus (Fortsetzung)

| (Angaben in Tausend) | Total Return Bond Fund | | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 6.785.948 | $ 7.695.274 | $ 29.083 | $ 44.804 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Finanzderivate | 151.351 | 121.401 | 5.409 | 6.577 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 0 | 9.129 | 22 | 2.959 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 64.763 | 80.095 | 2.034 | 4.103 |
| Forderungen aus Einkünften | 28.045 | 31.208 | 106 | 176 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 36.524 | 0 | 0 | 138 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 4.094.067 | 1.540.142 | 0 | 0 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 6.247 | 6.196 | 11 | 11 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 0 | 14.162 | 0 | 0 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Summe Aktiva** | 11.166.945 | 9.497.607 | 36.665 | 58.768 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (85.074) | (123.982) | (3.190) | (3.823) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | (246.378) | (74.424) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (84.717) | (93.247) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | (5.493.662) | (3.885.991) | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (7.168) | (15.035) | (853) | (20) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (3.278) | (3.416) | (46) | (78) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (244.346) | (340.704) | 0 | 0 |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (248) | (269) | 0 | 0 |
| Überziehungskredit | (20.036) | 0 | 0 | 0 |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | (37.994) | 0 | (1.873) | (2.389) |
| Einlagen von Kontrahenten | (56.456) | (60.809) | (261) | (611) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | 0 | (5) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (6.279.357) | (4.597.877) | (6.223) | (6.926) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 4.887.588 | $ 4.899.730 | $ 30.442 | $ 51.842 |

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

| | UK Corporate Bond Fund | | UK Long Term Corporate Bond Fund | | US High Yield Bond Fund | | US Investment Grade Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 |
| | £ 445.398 | £ 406.560 | £ 527.221 | £ 453.723 | $ 2.895.300 | $ 2.524.811 | $ 360.987 | $ 236.730 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 1.282 | 1.093 | 1.356 | 1.832 | 19.172 | 1.559 | 4.458 | 979 |
| | 2.120 | 1.441 | 2.634 | 1.148 | 0 | 0 | 162 | 458 |
| | 7.958 | 4.061 | 8.762 | 5.420 | 7.459 | 6.054 | 3.040 | 3.366 |
| | 4.793 | 4.061 | 6.500 | 5.509 | 42.047 | 42.304 | 3.403 | 2.136 |
| | 0 | 0 | 1 | 10 | 7.223 | 4 | 1.180 | 8 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 23.785 | 6.809 |
| | 742 | 30 | 4 | 21 | 2.942 | 10.686 | 299 | 63 |
| | 821 | 426 | 1.831 | 208 | 584 | 4.095 | 855 | 1.041 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 12 | 91 | 0 | 0 |
| | 463.114 | 417.672 | 548.309 | 467.871 | 2.974.739 | 2.589.604 | 398.169 | 251.590 |
| | (4.487) | (2.412) | (4.545) | (2.528) | (2.488) | (3.185) | (2.485) | (1.979) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (403) | 0 |
| | (3.785) | (56) | (6.052) | (170) | (20.603) | (18) | (5) | (871) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (49.968) | (21.031) |
| | (208) | (230) | (46) | (1) | (1.403) | (6.405) | (135) | (153) |
| | (126) | (118) | (155) | (146) | (1.538) | (1.428) | (111) | (77) |
| | (27.944) | (27.358) | (108.509) | (90.536) | (31.705) | (76.785) | (47.022) | (48.409) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (7.764) | 0 |
| | 0 | (2) | (2) | (5) | (85) | (92) | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | (8.943) | (4.102) | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (1.173) | (610) | (3.429) | (1.855) | (13.261) | (1.201) | (1.794) | (330) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (5) | (8) |
| | (37.723 ) | (30.786) | (122.738) | (95.241) | (80.026) | (93.216) | (109.692) | (72.858) |
| | £ 425.391 | £ 386.886 | £ 425.571 | £ 372.630 | $ 2.894.713 | $ 2.496.388 | $ 288.477 | $ 178.732 |

# Finanzstatus (Fortsetzung)

| (Angaben in Tausend) | US Short-Term Fund | | Summe der Gesellschaft* | |
|---|---|---|---|---|
| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018** |
| **Aktiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertetes Finanzvermögen: | | | | |
| Übertragbare Wertpapiere | $ 2.463.650 | $ 3.248.729 | $ 207.223.516 | $ 177.160.229 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 0 | 183.549 | 182.364 |
| Finanzderivate | 29.131 | 10.313 | 3.517.991 | 1.996.951 |
| Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente | 4.463 | 34.736 | 508.432 | 357.469 |
| Einlagen bei Kontrahenten | 20.972 | 19.740 | 2.560.164 | 2.827.871 |
| Forderungen aus Einkünften | 13.289 | 22.318 | 1.357.295 | 1.226.710 |
| Forderungen aus verkauften Anlagen | 23.322 | 550 | 1.254.615 | 211.730 |
| Forderungen aus verkauften TBA-Anlagen | 0 | 0 | 31.634.484 | 18.471.565 |
| Forderungen aus verkauften Fondsanteilen | 8.130 | 8.702 | 830.176 | 397.633 |
| Forderungen aus Derivate-Gewinnen | 23.997 | 12.354 | 1.093.541 | 298.848 |
| Sonstige Aktiva | 0 | 0 | 494 | 220 |
| **Summe Aktiva** | 2.586.954 | 3.357.442 | 250.164.257 | 203.131.590 |
| **Passiva:** | | | | |
| Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Finanzverbindlichkeiten: | | | | |
| Finanzderivate | (46.601) | (22.469) | (3.124.985) | (2.351.955) |
| Zeitwert der leerverkauften Wertpapiere | 0 | 0 | (2.832.799) | (1.475.199) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen | (68) | (1.983) | (1.736.511) | (1.800.192) |
| Verbindlichkeiten aus erworbenen TBA-Anlagen | 0 | 0 | (55.502.728) | (33.308.438) |
| Verbindlichkeiten aus Teilfondsrücknahmen | (2.031) | (801) | (559.242) | (340.425) |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühr | (759) | (829) | (116.618) | (103.295) |
| Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | (115.910) | (678.921) | (6.758.761) | (17.980.019) |
| Zahlbar für Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0 | 0 | (712.814) | (501.989) |
| Verbindlichkeiten aus Aufwendungen | (8) | (7) | (16.656) | (15.020) |
| Überziehungskredit | 0 | 0 | (266.273) | (8.492) |
| Verbindlichkeiten aus Derivatemargen | 0 | 0 | (141.475) | (11.486) |
| Einlagen von Kontrahenten | (8.516) | (2.013) | (1.770.344) | (911.326) |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 0 | 0 | (71) | (114) |
| **Summe Passiva ohne Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | (173.893) | (707.023) | (73.539.277) | (58.807.950) |
| **Nettovermögen der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber** | $ 2.413.061 | $ 2.650.419 | $ 176.624.980 | $ 144.323.640 |

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

* Die Summe der Gesellschaft zum 30. Juni 2019 und zum 31. Dezember 2018 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen und Salden im Namen der Gesellschaft Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten zu Überkreuzinvestitionen sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

** Die Summe der Gesellschaft zum 31. Dezember 2018 wurde nicht angepasst, um die Schließung des Emerging Markets 2018 Fund zu berücksichtigen.

(Diese Seite wurde absichtlich freigelassen.)

# Betriebsergebnisrechnung

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Asia High Yield Bond Fund<br>Berichtszeitraum vom 14. Feb. 2019 bis 30. Juni 2019 | PIMCO Capital Securities Fund<br>Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | PIMCO Capital Securities Fund<br>Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
|---|---|---|---|
| **Erträge** | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 1.709 | $ 165.111 | $ 194.321 |
| Sonstige Erträge | 0 | 16 | 3 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 306 | 10.605 | 143.066 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 14 | (30.181) | 2.033 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | 47 | (37.221) | (27.440) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 2.088 | 457.756 | (699.077) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (279) | (1.099) | (4.050) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 1 | 1.499 | (1.904) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 3.886 | 566.486 | (393.048) |
| **Betriebskosten** | | | |
| Verwaltungsgebühr | (35) | (31.255) | (41.575) |
| Servicegebühr | 0 | (789) | (879) |
| Bestandspflegegebühr | 0 | (779) | (1.085) |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | (146) | (169) |
| Gesamtaufwendungen | (35) | (32.969) | (43.708) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 1 | 938 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (34) | (32.031) | (43.708) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 3.852 | 534.455 | (436.756) |
| **Finanzierungskosten** | | | |
| Zinsaufwendungen | 0 | (12.790) | (7.594) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (57) | (40.891) | (49.395) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 12 | 1.335 | 58 |
| Summe Finanzierungskosten | (45) | (52.346) | (56.931) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 3.807 | 482.109 | (493.687) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (7) | 536 | (1.372) |
| Kapitalertragsteuer | (3) | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 3.797 | 482.645 | (495.059) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ 3.797 | $ 482.645 | $ (495.059) |

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

| | Commodity Real Return Fund | | PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | | Diversified Income Fund | | Diversified Income Duration Hedged Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ | 8.330 | $ 8.764 | $ 3.779 | $ 6.343 | $ 161.115 | $ 156.135 | $ 28.800 | $ 26.804 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 4 | 0 | 0 |
| | 4.805 | (1.266) | (670) | (3.587) | 13.350 | 26.243 | 1.891 | 5.548 |
| | (18.462) | 27.740 | (3.553) | (2.486) | 58.081 | (167.118) | (25.524) | (5.268) |
| | (455) | 50 | (34) | (185) | (22.065) | (16.745) | (2.295) | (2.027) |
| | 12.814 | (13.812) | 6.833 | (3.984) | 349.088 | (287.146) | 64.743 | (53.893) |
| | 35.524 | (24.479) | 1.554 | (1.378) | 100.068 | (61.304) | 1.251 | (15.997) |
| | 8 | 102 | 32 | 211 | 699 | 2.412 | 144 | 598 |
| | 42.564 | (2.901) | 7.941 | (5.066) | 660.336 | (347.519) | 69.010 | (44.235) |
| | (2.582) | (2.714) | (832) | (1.444) | (38.636) | (40.357) | (6.446) | (6.090) |
| | (33) | (38) | 0 | 0 | (74) | (106) | (30) | (29) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | (58) | (59) | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | (2) | (3) | (121) | (164) | (4) | (6) |
| | (2.615) | (2.752) | (834) | (1.447) | (38.889) | (40.686) | (6.480) | (6.125) |
| | 42 | 42 | 1 | 1 | 512 | 514 | 92 | 92 |
| | (2.573) | (2.710) | (833) | (1.446) | (38.377) | (40.172) | (6.388) | (6.033) |
| | 39.991 | (5.611) | 7.108 | (6.512) | 621.959 | (387.691) | 62.622 | (50.268) |
| | (2.743) | (567) | (16) | (338) | (589) | (268) | (142) | (307) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | (15) | (578) | (63.407) | (53.475) | (6.208) | (9.418) |
| | (2) | 0 | 0 | (185) | 3.280 | (301) | (87) | 297 |
| | (2.745) | (567) | (31) | (1.101) | (60.716) | (54.044) | (6.437) | (9.428) |
| | 37.246 | (6.178) | 7.077 | (7.613) | 561.243 | (441.735) | 56.185 | (59.696) |
| | 0 | 0 | (1) | (14) | 0 | (1) | 0 | 0 |
| | 0 | (4) | 0 | 0 | 0 | (14) | 0 | (2) |
| | 37.246 | (6.182) | 7.076 | (7.627) | 561.243 | (441.750) | 56.185 | (59.698) |
| $ | 37.246 | $ (6.182) | $ 7.076 | $ (7.627) | $ 561.243 | $ (441.750) | $ 56.185 | $ (59.698) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Dynamic Bond Fund | | Dynamic Multi-Asset Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 59.643 | $ 46.181 | € 7.156 | € 1.879 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 3 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 23.633 | (12.743) | 5.663 | 1.279 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (40.642) | 11.254 | 2.338 | (17.595) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (2.477) | (1.510) | 1.681 | 64 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 76.123 | (36.519) | 38.193 | 4.466 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (19.958) | (39.412) | 11.008 | (474) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 561 | 1.674 | 68 | (34) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 96.883 | (31.075) | 66.107 | (10.412) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (16.284) | (12.609) | (7.736) | (7.197) |
| Servicegebühr | (131) | (91) | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | (140) | (201) | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | (2) | (2) | (21) | (46) |
| Gesamtaufwendungen | (16.557) | (12.903) | (7.757) | (7.243) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 233 | 234 | 82 | 47 |
| Betriebskosten, netto | (16.324) | (12.669) | (7.675) | (7.196) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 80.559 | (43.744) | 58.432 | (17.608) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (811) | (3.756) | (155) | (348) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (4.434) | (2.285) | (177) | (18) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 1.199 | 46 | 1 | (14) |
| Summe Finanzierungskosten | (4.046) | (5.995) | (331) | (380) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 76.513 | (49.739) | 58.101 | (17.988) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (8) | (72) | (570) | (199) |
| Kapitalertragsteuer | 1 | (1) | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 76.506 | (49.812) | 57.531 | (18.187) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ 76.506 | $ (49.812) | € 57.531 | € (18.187) |

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

| Emerging Asia Bond Fund | | Emerging Local Bond Fund | | Emerging Markets Bond Fund | | Emerging Markets Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 824 | $ 795 | $ 81.903 | $ 101.548 | $ 84.940 | $ 69.029 | $ 6.270 | $ 6.444 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 2 | 1 | 0 | 0 |
| 201 | (131) | (43.418) | (118.128) | 6.660 | (3.401) | 1.401 | (1.479) |
| 139 | (59) | 873 | (34.068) | (47.768) | (41.821) | (3.735) | (5.006) |
| (13) | (21) | (46) | 20.979 | (3.126) | 739 | (12) | 3 |
| 2.004 | (1.486) | 178.211 | (123.057) | 223.482 | (193.342) | 10.683 | (9.708) |
| 36 | (11) | 44.379 | (20.751) | 43.295 | (37.313) | 2.662 | (1.391) |
| 0 | 28 | (2.966) | (5.322) | 370 | (1.514) | (24) | (74) |
| 3.191 | (885) | 258.936 | (178.799) | 307.855 | (207.622) | 17.245 | (11.211) |
| (259) | (278) | (11.602) | (14.204) | (14.482) | (13.917) | (1.302) | (1.458) |
| 0 | 0 | (53) | (41) | (18) | (25) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (64) | (72) | 0 | (1) |
| 0 | 0 | (2) | (3) | (2) | (4) | 0 | 0 |
| (259) | (278) | (11.657) | (14.248) | (14.566) | (14.018) | (1.302) | (1.459) |
| 2 | 0 | 6 | 0 | 0 | 117 | 0 | 0 |
| (257) | (278) | (11.651) | (14.248) | (14.566) | (13.901) | (1.302) | (1.459) |
| 2.934 | (1.163) | 247.285 | (193.047) | 293.289 | (221.523) | 15.943 | (12.670) |
| 0 | (1) | (1.509) | (431) | (227) | (114) | (106) | (124) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (562) | (649) | (28.701) | (41.098) | (36.646) | (29.322) | (279) | (280) |
| (4) | (3) | 20 | (3.784) | 3.098 | (396) | 6 | 44 |
| (566) | (653) | (30.190) | (45.313) | (33.775) | (29.832) | (379) | (360) |
| 2.368 | (1.816) | 217.095 | (238.360) | 259.514 | (251.355) | 15.564 | (13.030) |
| (3) | (1) | (508) | (617) | (21) | (10) | (5) | (6) |
| 0 | 0 | (668) | 339 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.365 | (1.817) | 215.919 | (238.638) | 259.493 | (251.365) | 15.559 | (13.036) |
| $ 2.365 | $ (1.817) | $ 215.919 | $ (238.638) | $ 259.493 | $ (251.365) | $ 15.559 | $ (13.036) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | |
|---|---|---|---|
| | Berichtszeitraum vom 04. Juni 2019 bis 30. Juni 2019 | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 516 | $ 1.390 | $ 1.266 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 163 | (531) | (147) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 349 | (86) | 75 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | 31 | (54) | (19) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 1.653 | 1.437 | (1.168) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | 1.697 | 925 | (2.396) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 44 | 5 | (10) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 4.453 | 3.086 | (2.399) |
| **Betriebskosten** | | | |
| Verwaltungsgebühr | (76) | (392) | (379) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | 0 | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (76) | (392) | (379) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 3 | 5 | 5 |
| Betriebskosten, netto | (73) | (387) | (374) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 4.380 | 2.699 | (2.773) |
| **Finanzierungskosten** | | | |
| Zinsaufwendungen | 0 | (5) | (9) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | 0 | (35) | (34) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 0 | 3 | (1) |
| Summe Finanzierungskosten | 0 | (37) | (44) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 4.380 | 2.662 | (2.817) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 0 | 0 | (6) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | (1) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 4.380 | 2.662 | (2.824) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ 4.380 | $ 2.662 | $ (2.824) |

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

| | Euro Bond Fund | | Euro Credit Fund | | Euro Income Bond Fund | | Euro Long Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| € | 14.023 | € 7.859 | € 7.080 | € 5.727 | € 22.689 | € 15.434 | € 2.068 | € 1.640 |
| | 0 | 17 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 16.768 | (3.233) | 4.662 | 214 | 14.757 | 3.283 | 4.201 | (812) |
| | 31.033 | (8.344) | 3.200 | (2.157) | (15.503) | (3.684) | 14.094 | 2.044 |
| | 2.137 | (2.435) | 641 | (985) | 1.003 | (3.160) | (288) | (206) |
| | 47.492 | 7.703 | 24.736 | (3.780) | 56.926 | (15.159) | 19.181 | 3.907 |
| | 23.842 | 14.767 | 5.957 | 3.641 | 7.524 | (874) | 348 | 2.847 |
| | 3.261 | (4.199) | 701 | (703) | 2.811 | 92 | 303 | (733) |
| | 138.556 | 12.135 | 46.977 | 1.957 | 90.207 | (4.068) | 39.907 | 8.687 |
| | (5.653) | (3.731) | (2.069) | (1.769) | (10.324) | (7.721) | (646) | (535) |
| | (38) | (27) | 0 | 0 | (20) | (11) | 0 | 0 |
| | (11) | (9) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (2) | (7) | 0 | 0 | (65) | (50) | 0 | (1) |
| | (5.704) | (3.774) | (2.069) | (1.769) | (10.409) | (7.782) | (646) | (536) |
| | 362 | 246 | 101 | 73 | 204 | 187 | 34 | 31 |
| | (5.342) | (3.528) | (1.968) | (1.696) | (10.205) | (7.595) | (612) | (505) |
| | 133.214 | 8.607 | 45.009 | 261 | 80.002 | (11.663) | 39.295 | 8.182 |
| | (222) | (154) | (43) | (44) | (189) | (146) | (21) | (29) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (384) | (224) | (988) | (1.154) | (12.488) | (10.481) | 0 | 0 |
| | 3 | 2 | 27 | (136) | 108 | 18 | 0 | 0 |
| | (603) | (376) | (1.004) | (1.334) | (12.569) | (10.609) | (21) | (29) |
| | 132.611 | 8.231 | 44.005 | (1.073) | 67.433 | (22.272) | 39.274 | 8.153 |
| | (4) | (14) | 8 | (1) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 0 | 0 | 0 | (10) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 132.607 | 8.217 | 44.013 | (1.084) | 67.433 | (22.272) | 39.274 | 8.153 |
| € | 132.607 | € 8.217 | € 44.013 | € (1.084) | € 67.433 | € (22.272) | € 39.274 | € 8.153 |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Euro Low Duration Fund | | Euro Short-Term Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | € 534 | € 1.133 | € 1.208 | € 2.001 |
| Sonstige Erträge | 1 | 5 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 1.067 | (3.004) | (403) | (15.242) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 586 | 859 | (2.201) | 4.652 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | 29 | (240) | 447 | (2.354) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 601 | (730) | 2.166 | 1.598 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | 1.205 | (433) | 2.401 | 842 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (23) | 1 | (25) | 0 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 4.000 | (2.409) | 3.593 | (8.503) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (811) | (1.504) | (2.698) | (4.064) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | (4) | 0 | (2) |
| Gesamtaufwendungen | (811) | (1.508) | (2.698) | (4.066) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 45 | 2 | 0 | 17 |
| Betriebskosten, netto | (766) | (1.506) | (2.698) | (4.049) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 3.234 | (3.915) | 895 | (12.552) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (9) | (35) | (64) | (44) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | 0 | 0 | 0 | (89) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 0 | 0 | 0 | (4) |
| Summe Finanzierungskosten | (9) | (35) | (64) | (137) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 3.225 | (3.950) | 831 | (12.689) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 1 | (1) | 0 | 0 |
| Kapitalertragsteuer | 0 | (1) | 0 | (1) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 3.226 | (3.952) | 831 | (12.690) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | € 3.226 | € (3.952) | € 831 | € (12.690) |

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

| Global Advantage Fund | | Global Advantage Real Return Fund | | Global Bond Fund | | Global Bond ESG Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 12.881 | $ 11.463 | $ 1.451 | $ 2.946 | $ 154.451 | $ 118.560 | $ 7.041 | $ 4.283 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 268 | 125 | 0 | 0 |
| 5.308 | 41 | (870) | (406) | 62.329 | 62.623 | 1.638 | 2.014 |
| (6.987) | 1.619 | (733) | (2.060) | 75.882 | (51.090) | (6.479) | (7.940) |
| (1.919) | (10.720) | 54 | (192) | (84.995) | (144.634) | (3.650) | (2.228) |
| 29.268 | (23.551) | 4.813 | (5.903) | 408.188 | (311.232) | 21.170 | (10.432) |
| 5.791 | (10.330) | 1.370 | (191) | 76.695 | 48.655 | 14.100 | 2.520 |
| (125) | 7.828 | (155) | 847 | (2.712) | 108.185 | (274) | 834 |
| 44.217 | (23.650) | 5.930 | (4.959) | 690.106 | (168.808) | 33.546 | (10.949) |
| (2.720) | (2.832) | (319) | (549) | (37.258) | (33.753) | (1.468) | (1.101) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (1.315) | (1.340) | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (34) | (46) | 0 | 0 |
| (1) | (1) | 0 | 0 | (54) | (55) | 0 | (10) |
| (2.721) | (2.833) | (319) | (549) | (38.661) | (35.194) | (1.468) | (1.111) |
| 5 | 34 | 0 | 0 | 1.117 | 892 | 0 | 0 |
| (2.716) | (2.799) | (319) | (549) | (37.544) | (34.302) | (1.468) | (1.111) |
| 41.501 | (26.449) | 5.611 | (5.508) | 652.562 | (203.110) | 32.078 | (12.060) |
| (940) | (556) | (269) | (280) | (2.404) | (1.593) | (182) | (381) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (1.483) | (1.125) | (247) | (667) | (21.210) | (14.118) | (1.780) | (688) |
| 181 | (36) | 18 | (14) | 951 | (679) | 249 | 133 |
| (2.242) | (1.717) | (498) | (961) | (22.663) | (16.390) | (1.713) | (936) |
| 39.259 | (28.166) | 5.113 | (6.469) | 629.899 | (219.500) | 30.365 | (12.996) |
| (88) | (75) | (5) | (8) | (16) | 7 | (5) | 0 |
| (39) | 13 | 6 | 2 | 1 | (9) | 0 | 0 |
| 39.132 | (28.228) | 5.114 | (6.475) | 629.884 | (219.502) | 30.360 | (12.996) |
| $ 39.132 | $ (28.228) | $ 5.114 | $ (6.475) | $ 629.884 | $ (219.502) | $ 30.360 | $ (12.996) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Global Bond Ex-US Fund | | Global High Yield Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 12.969 | $ 11.628 | $ 95.401 | $ 133.094 |
| Sonstige Erträge | 4 | 2 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 7.004 | 4.319 | (15.980) | 32.511 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 20.750 | 16.773 | (38.980) | (20.964) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (5.125) | (12.487) | (5.189) | 3.062 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 35.970 | (26.912) | 246.134 | (219.496) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (12.308) | 12.242 | 34.877 | (33.552) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (2.074) | 10.692 | 56 | 75 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 57.190 | 16.257 | 316.319 | (105.270) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (3.457) | (3.345) | (13.294) | (17.899) |
| Servicegebühr | (19) | (15) | (29) | (41) |
| Bestandspflegegebühr | (25) | (23) | (187) | (245) |
| Sonstige Aufwendungen | (1) | (1) | (25) | (34) |
| Gesamtaufwendungen | (3.502) | (3.384) | (13.535) | (18.219) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 9 | 12 | 198 | 263 |
| Betriebskosten, netto | (3.493) | (3.372) | (13.337) | (17.956) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 53.697 | 12.885 | 302.982 | (123.226) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (750) | (446) | (463) | (301) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | (376) | (860) |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (2.006) | (1.353) | (37.052) | (45.865) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 22 | 14 | 1.712 | (3.189) |
| Summe Finanzierungskosten | (2.734) | (1.785) | (36.179) | (50.215) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 50.963 | 11.100 | 266.803 | (173.441) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (18) | (20) | (19) | (209) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | (1) | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 50.945 | 11.079 | 266.784 | (173.650) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ 50.945 | $ 11.079 | $ 266.784 | $ (173.650) |

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

(1) Der Global Investment Grade Credit ESG Fund wurde am 28. September 2018 aufgelegt.

| Global Investment Grade Credit Fund | | Global Investment Grade Credit ESG Fund[1] | Global Libor Plus Bond Fund | | Global Low Duration Real Return Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 357.113 | $ 380.397 | $ 860 | $ 19.951 | $ 8.682 | $ 16.288 | $ 30.017 |
| 7 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 2 |
| 30.902 | (66.381) | 740 | 8.954 | 1.458 | 5.857 | 2.405 |
| (24.121) | (197.963) | (1.130) | (21.156) | (16.621) | (15.114) | (15.529) |
| (30.383) | (10.519) | (144) | 122 | (607) | (5.491) | 125 |
| 1.013.566 | (722.092) | 3.063 | 30.932 | (10.611) | 32.883 | (51.892) |
| 66.233 | (104.956) | 724 | (11.220) | (7.488) | 580 | (467) |
| (1.217) | 5.587 | 0 | (89) | (17) | 87 | (205) |
| 1.412.100 | (715.926) | 4.113 | 27.494 | (25.204) | 35.090 | (35.544) |
| (54.670) | (60.764) | (128) | (3.230) | (1.542) | (3.383) | (5.262) |
| (2.843) | (1.829) | 0 | (8) | (2) | (13) | (10) |
| (701) | (924) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (68) | (73) | (1) | (1) | (15) | (1) | (1) |
| (58.282) | (63.590) | (129) | (3.239) | (1.559) | (3.397) | (5.273) |
| 454 | 456 | 0 | 108 | 98 | 0 | 0 |
| (57.828) | (63.134) | (129) | (3.131) | (1.461) | (3.397) | (5.273) |
| 1.354.272 | (779.060) | 3.984 | 24.363 | (26.665) | 31.693 | (40.817) |
| (14.609) | (13.159) | (10) | (69) | (84) | (5.558) | (3.784) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (107.022) | (115.558) | (66) | (3.934) | (159) | (1.364) | (2.816) |
| 2.593 | (1.520) | 11 | 1.048 | 57 | 8 | 154 |
| (119.038) | (130.237) | (65) | (2.955) | (186) | (6.914) | (6.446) |
| 1.235.234 | (909.297) | 3.919 | 21.408 | (26.851) | 24.779 | (47.263) |
| 29 | (694) | (3) | 0 | (2) | 0 | 0 |
| 10 | (3) | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 |
| 1.235.273 | (909.994) | 3.916 | 21.409 | (26.853) | 24.779 | (47.263) |
| $ 1.235.273 | $ (909.994) | $ 3.916 | $ 21.409 | $ (26.853) | $ 24.779 | $ (47.263) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Global Multi-Asset Fund | | Global Real Return Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 12.702 | $ 12.802 | $ 23.585 | $ 37.496 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (197) | (10.877) | 7.194 | 4.889 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 4.275 | 4.727 | (788) | 4.716 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (620) | (257) | (7.165) | (2.464) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 51.979 | (11.604) | 119.927 | (100.202) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | 10.119 | (14.349) | (7.386) | 14.024 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (54) | 27 | (778) | 3.625 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 78.204 | (19.531) | 134.589 | (37.916) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (5.156) | (6.359) | (6.485) | (7.504) |
| Servicegebühr | (14) | (23) | (133) | (188) |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | (164) | (224) |
| Sonstige Aufwendungen | (1) | (2) | (1) | (3) |
| Gesamtaufwendungen | (5.171) | (6.384) | (6.783) | (7.919) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 269 | 330 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (4.902) | (6.054) | (6.783) | (7.919) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 73.302 | (25.585) | 127.806 | (45.835) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (1.886) | (1.094) | (6.717) | (6.088) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (1.160) | (756) | (1.690) | (3.654) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 277 | (422) | 22 | 17 |
| Summe Finanzierungskosten | (2.769) | (2.272) | (8.385) | (9.725) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 70.533 | (27.857) | 119.421 | (55.560) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (524) | (234) | 0 | 0 |
| Kapitalertragsteuer | 21 | (33) | 1 | (17) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 70.030 | (28.124) | 119.422 | (55.577) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ 70.030 | $ (28.124) | $ 119.422 | $ (55.577) |

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

| Income Fund | | Inflation Strategy Fund | | Low Average Duration Fund | | Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 1.387.749 | $ 1.181.169 | $ 1.275 | $ 1.362 | $ 24.220 | $ 16.449 | $ 9.290 | $ 9.321 |
| 27 | 87 | 0 | 0 | 2 | 1 | 0 | 3 |
| 303.336 | 376.266 | 938 | (247) | (4.718) | 37.466 | 63 | (1.221) |
| 75.360 | (1.132.593) | 571 | (296) | (14.739) | (55.973) | (12.904) | (12.309) |
| (65.569) | (100.197) | (87) | 85 | 262 | (2.483) | (539) | (378) |
| 2.179.454 | (1.806.350) | 4.337 | (2.236) | 21.987 | (47.622) | 13.205 | (10.006) |
| (62.752) | (592.262) | 1.198 | (1.632) | 9.886 | 30.812 | 7.486 | (4.387) |
| (10.713) | 9.180 | (54) | (15) | 219 | (288) | (36) | 44 |
| 3.806.892 | (2.064.700) | 8.178 | (2.979) | 37.119 | (21.638) | 16.565 | (18.933) |
| (298.829) | (332.469) | (460) | (591) | (2.961) | (4.359) | (1.310) | (1.601) |
| (6.646) | (4.792) | 0 | 0 | (128) | (157) | 0 | 0 |
| (15.259) | (15.797) | 0 | 0 | (41) | (57) | 0 | 0 |
| (1.984) | (2.138) | 0 | (1) | (1) | (1) | 0 | 0 |
| (322.718) | (355.196) | (460) | (592) | (3.131) | (4.574) | (1.310) | (1.601) |
| 510 | 511 | 0 | 0 | 129 | 129 | 0 | 0 |
| (322.208) | (354.685) | (460) | (592) | (3.002) | (4.445) | (1.310) | (1.601) |
| 3.484.684 | (2.419.385) | 7.718 | (3.571) | 34.117 | (26.083) | 15.255 | (20.534) |
| (87.274) | (45.315) | (204) | (65) | (3.667) | (327) | (821) | (605) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (620.657) | (628.611) | (7) | (33) | (1.382) | (2.079) | 0 | 0 |
| 14.144 | 2.054 | 6 | (2) | (545) | (232) | 0 | 0 |
| (693.787) | (671.872) | (205) | (100) | (5.594) | (2.638) | (821) | (605) |
| 2.790.897 | (3.091.257) | 7.513 | (3.671) | 28.523 | (28.721) | 14.434 | (21.139) |
| (1.591) | (1.505) | (72) | (35) | 0 | (6) | (1) | (18) |
| 542 | (948) | 0 | 0 | 4 | (265) | 0 | (2) |
| 2.789.848 | (3.093.710) | 7.441 | (3.706) | 28.527 | (28.992) | 14.433 | (21.159) |
| $ 2.789.848 | $ (3.093.710) | $ 7.441 | $ (3.706) | $ 28.527 | $ (28.992) | $ 14.433 | $ (21.159) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Low Duration Income Fund | | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Berichtszeitraum vom 31. Mai 2018 bis 30. Juni 2018 | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 7.386 | $ 71 | $ 3.748 | $ 3.342 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 3.319 | 28 | 1.116 | 1.806 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | (7.344) | (629) | 14.392 | (699) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | (373) | 52 | 15 | 2.068 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 7.138 | 805 | 5.429 | 2.788 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | 2.074 | (796) | 13.925 | (5.004) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (14) | (14) | 1 | 4 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 12.186 | (483) | 38.626 | 4.305 |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (1.043) | (29) | (1.243) | (1.428) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | (13) | (3) |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | (9) | 0 | 0 | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (1.052) | (29) | (1.256) | (1.431) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Betriebskosten, netto | (1.052) | (29) | (1.256) | (1.431) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 11.134 | (512) | 37.370 | 2.874 |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (44) | 0 | (18) | (33) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (69) | 0 | (3.214) | (3.586) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 0 | 0 | 7 | (741) |
| Summe Finanzierungskosten | (113) | 0 | (3.225) | (4.360) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 11.021 | (512) | 34.145 | (1.486) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (2) | 0 | (181) | (647) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 11.019 | (512) | 33.964 | (2.133) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ 11.019 | $ (512) | $ 33.964 | $ (2.133) |

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

| Mortgage Opportunities Fund | | PIMCO RAE Emerging Markets Fund | | PIMCO RAE Europe Fund | | PIMCO RAE Global Developed Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 45.587 | $ 41.210 | $ 1.813 | $ 1.109 | € 305 | € 511 | $ 1.054 | $ 1.380 |
| 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (8.659) | (14.294) | (3.296) | 3.675 | (346) | 25 | (171) | 4.529 |
| (31.427) | (33.318) | (2) | 0 | 0 | 0 | (9) | 0 |
| (419) | 387 | (6) | 30 | (1) | (4) | 17 | (53) |
| 52.864 | (21.440) | 11.027 | (9.172) | 877 | (1.103) | 3.734 | (5.965) |
| (7.143) | (2.502) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (57) | 370 | (2) | (3) | 0 | 0 | 1 | (8) |
| 50.746 | (29.586) | 9.534 | (4.361) | 835 | (571) | 4.626 | (117) |
| (6.200) | (7.986) | (227) | (141) | (32) | (50) | (238) | (269) |
| (42) | (66) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2) | (3) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (2) | (20) | 0 | (4) | 0 | (1) | 0 | (3) |
| (6.246) | (8.075) | (227) | (145) | (32) | (51) | (238) | (272) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (6.246) | (8.075) | (227) | (145) | (32) | (51) | (238) | (272) |
| 44.500 | (37.661) | 9.307 | (4.506) | 803 | (622) | 4.388 | (389) |
| (9.126) | (4.202) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (8.333) | (8.809) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (100) | (216) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (17.559) | (13.227) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 26.941 | (50.888) | 9.307 | (4.506) | 803 | (622) | 4.388 | (389) |
| (3) | 126 | (259) | (115) | (26) | (42) | (158) | (215) |
| 0 | 0 | (108) | (34) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 26.938 | (50.762) | 8.940 | (4.655) | 777 | (664) | 4.230 | (604) |
| $ 26.938 | $ (50.762) | $ 8.940 | $ (4.655) | € 777 | € (664) | $ 4.230 | $ (604) |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | | PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 471 | $ 967 | $ 3.148 | $ 5.605 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 546 | 860 | 4.300 | 398 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 118 | 1.294 | (3.767) | 2.982 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | 5 | (283) | 31 | (459) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 337 | (1.226) | 4.913 | (5.112) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | 1.298 | (5.518) | 14.339 | (9.253) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 2 | 0 | 6 | (19) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 2.777 | (3.906) | 22.970 | (5.858) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (323) | (651) | (2.021) | (3.051) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (323) | (651) | (2.021) | (3.051) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 4 | 12 | 28 | 62 |
| Betriebskosten, netto | (319) | (639) | (1.993) | (2.989) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 2.458 | (4.545) | 20.977 | (8.847) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (10) | (22) | (499) | (899) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | 0 | 0 | 0 | (80) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | (1) | 0 | 0 | 0 |
| Summe Finanzierungskosten | (11) | (22) | (499) | (979) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 2.447 | (4.567) | 20.478 | (9.826) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 0 | 0 | (439) | (519) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 2.447 | (4.567) | 20.039 | (10.345) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ 2.447 | $ (4.567) | $ 20.039 | $ (10.345) |

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

(2) Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund wurde am 16. November 2018 aufgelegt.

(3) Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund wurde am 16. November 2018 aufgelegt.

(4) Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund wurde am 16. November 2018 aufgelegt.

| PIMCO RAE PLUS US Fund | | PIMCO RAE US Fund | | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund[2] | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund[3] | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund[4] |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2019 bis 05. Juni 2019 | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 266 | $ 1.690 | $ 181 | $ 174 | $ 153 | € 126 | $ 89 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (647) | 1.069 | 105 | 622 | 10 | 7 | 3 |
| 4.796 | 950 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 |
| (56) | 143 | 0 | (4) | (6) | 0 | 0 |
| 1.202 | (1.625) | 1.347 | (619) | 902 | 470 | 598 |
| 1.672 | (284) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2 | (15) | 1 | 0 | 1 | 0 | 0 |
| 7.235 | 1.928 | 1.634 | 173 | 1.061 | 603 | 690 |
| (90) | (598) | (32) | (33) | (26) | (9) | (10) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | (1) | 0 | 0 | 0 |
| (90) | (598) | (32) | (34) | (26) | (9) | (10) |
| 1 | 18 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (89) | (580) | (32) | (34) | (26) | (9) | (10) |
| 7.146 | 1.348 | 1.602 | 139 | 1.035 | 594 | 680 |
| (22) | (65) | 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 |
| (22) | (65) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 7.124 | 1.283 | 1.602 | 139 | 1.035 | 594 | 680 |
| (35) | (523) | (48) | (49) | (20) | (15) | (17) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (21) | 0 | 0 |
| 7.089 | 760 | 1.554 | 90 | 994 | 579 | 663 |
| $ 7.089 | $ 760 | $ 1.554 | $ 90 | $ 994 | € 579 | $ 663 |

# Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund[5] | Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | |
|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | $ 37 | $ 16.256 | $ 12.738 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | (8) | (2.284) | 1.848 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 0 | (8.252) | (12.332) |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | 0 | (270) | 44 |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 423 | 45.038 | (37.287) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | 0 | 7.650 | (4.787) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | 0 | (5) | (129) |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 452 | 58.133 | (39.905) |
| **Betriebskosten** | | | |
| Verwaltungsgebühr | (4) | (2.691) | (2.398) |
| Servicegebühr | 0 | (4) | (4) |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | 0 | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (4) | (2.695) | (2.402) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 0 | 8 | 22 |
| Betriebskosten, netto | (4) | (2.687) | (2.380) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 448 | 55.446 | (42.285) |
| **Finanzierungskosten** | | | |
| Zinsaufwendungen | 0 | (97) | (9) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | 0 | (3.764) | (1.828) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | 0 | 357 | 370 |
| Summe Finanzierungskosten | 0 | (3.504) | (1.467) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 448 | 51.942 | (43.752) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | (12) | (2) | 0 |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 436 | 51.940 | (43.752) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | $ 436 | $ 51.940 | $ (43.752) |

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

[5] Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund wurde am 16. November 2018 aufgelegt.

| | StocksPLUS™ Fund | | PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Strategic Income Fund | | Total Return Bond Fund | | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Berichtszeitraum vom 29. März 2019 bis 30. Juni 2019 | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ | 38.934 | $ 19.084 | $ 42 | $ 21.742 | $ 15.605 | $ 87.952 | $ 93.719 | $ 587 | $ 1.477 |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | 9.696 | 28.154 | 8 | 2.948 | 9.624 | 46.928 | (1.373) | (9) | 756 |
| | 151.897 | 11.663 | 166 | (16.553) | (30.034) | (59.927) | (119.827) | (776) | (7.598) |
| | 23 | (954) | 0 | (155) | (867) | (5.432) | (5.776) | 25 | (226) |
| | 35.265 | (22.779) | 51 | 43.903 | (32.194) | 140.413 | (187.102) | 196 | (358) |
| | 224.272 | (14.953) | 11 | 8.458 | (2.796) | 68.289 | 22.252 | (519) | (651) |
| | 81 | (71) | 0 | (191) | (72) | 690 | (874) | 8 | (56) |
| | 460.168 | 20.144 | 278 | 60.152 | (40.734) | 278.913 | (198.981) | (488) | (6.656) |
| | (8.237) | (5.665) | (9) | (5.914) | (5.205) | (20.170) | (25.423) | (315) | (973) |
| | (15) | (30) | 0 | 0 | 0 | (968) | (1.216) | (1) | (1) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (510) | (709) | 0 | 0 |
| | (3) | (2) | 0 | (76) | (72) | (15) | (19) | 0 | (3) |
| | (8.255) | (5.697) | (9) | (5.990) | (5.277) | (21.663) | (27.367) | (316) | (977) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 572 | 574 | 0 | 20 |
| | (8.255) | (5.697) | (9) | (5.990) | (5.277) | (21.091) | (26.793) | (316) | (957) |
| | 451.913 | 14.447 | 269 | 54.162 | (46.011) | 257.822 | (225.774) | (804) | (7.613) |
| | (732) | (357) | (1) | (289) | (129) | (3.961) | (9.460) | (8) | (45) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | (66) | 0 | 0 | (3.505) | (2.375) | (10.883) | (9.822) | (11) | (30) |
| | 0 | (107) | 0 | 223 | 77 | (198) | 38 | (1) | (10) |
| | (798) | (464) | (1) | (3.571) | (2.427) | (15.042) | (19.244) | (20) | (85) |
| | 451.115 | 13.983 | 268 | 50.591 | (48.438) | 242.780 | (245.018) | (824) | (7.698) |
| | 3 | (38) | 0 | (963) | (735) | (24) | (54) | (1) | (1) |
| | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 3 | 0 | 0 | 0 |
| | 451.118 | 13.945 | 268 | 49.628 | (49.173) | 242.759 | (245.072) | (825) | (7.699) |
| $ | 451.118 | $ 13.945 | $ 268 | $ 49.628 | $ (49.173) | $ 242.759 | $ (245.072) | $ (825) | $ (7.699) |

## Betriebsergebnisrechnung (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | UK Corporate Bond Fund | | UK Long Term Corporate Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Erträge** | | | | |
| Zins- und Dividendenerträge | £ 6.022 | £ 6.098 | £ 7.709 | £ 8.061 |
| Sonstige Erträge | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 1.213 | 977 | 1.380 | 3.011 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus derivativen Finanzinstrumenten | 1.295 | 44 | 1.448 | 1.858 |
| Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährung | 845 | 116 | 660 | (165) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus übertragbaren Wertpapieren und Einlagen bei Kreditinstituten | 21.537 | (13.727) | 31.750 | (19.630) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus derivativen Finanzinstrumenten | (1.795) | (688) | (2.392) | (1.458) |
| Nettoänderung in der nicht realisierten Wertzunahme/(-abnahme) aus Fremdwährung | (7) | (351) | (15) | 18 |
| Gesamtanlageertrag/(-verlust) | 29.110 | (7.531) | 40.540 | (8.305) |
| **Betriebskosten** | | | | |
| Verwaltungsgebühr | (797) | (874) | (903) | (966) |
| Servicegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Bestandspflegegebühr | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Sonstige Aufwendungen | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Gesamtaufwendungen | (797) | (874) | (903) | (966) |
| Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft | 67 | 77 | 13 | 28 |
| Betriebskosten, netto | (730) | (797) | (890) | (938) |
| **Anlageerträge/(-verluste), netto** | 28.380 | (8.328) | 39.650 | (9.243) |
| **Finanzierungskosten** | | | | |
| Zinsaufwendungen | (139) | (97) | (467) | (290) |
| Aufwand für Kreditfazilitäten | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ausschüttungen an rückgabe- und gewinnberechtigte Anteilinhaber | (2.550) | (1.889) | (2.174) | (1.458) |
| Nettoausgleichskredite und -gebühren | (34) | (3) | (52) | 298 |
| Summe Finanzierungskosten | (2.723) | (1.989) | (2.693) | (1.450) |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum vor Steuern** | 25.657 | (10.317) | 36.957 | (10.693) |
| Quellensteuern auf Dividenden und sonstige Anlageerträge | 0 | (1) | 0 | (1) |
| Kapitalertragsteuer | 0 | 0 | 0 | 0 |
| **Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum nach Steuern** | 25.657 | (10.318) | 36.957 | (10.694) |
| **Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit** | £ 25.657 | £ (10.318) | £ 36.957 | £ (10.694) |

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

* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2019 und zum 30. Juni 2018 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten hierzu sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

| US High Yield Bond Fund | | US Investment Grade Corporate Bond Fund | | US Short-Term Fund | | Summe der Gesellschaft* | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 84.573 | $ 87.220 | $ 5.082 | $ 3.370 | $ 44.577 | $ 22.043 | $ 3.126.808 | $ 2.944.753 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 327 | 260 |
| (3.622) | 8.152 | 3.399 | (1.825) | 5.800 | 769 | 545.991 | 507.378 |
| (18.002) | (20.260) | (3.081) | (709) | (31.397) | (11.949) | (44.529) | (1.948.354) |
| (343) | (198) | (42) | (37) | (2.673) | (241) | (279.536) | (327.776) |
| 175.568 | (90.887) | 13.735 | (6.244) | 21.073 | (6.962) | 6.432.258 | (5.259.614) |
| 18.720 | (10.657) | 2.874 | (1.950) | (3.993) | 1.033 | 751.291 | (884.394) |
| 3 | (42) | (16) | 16 | 5 | (35) | (9.045) | 134.472 |
| 256.897 | (26.672) | 21.951 | (7.379) | 33.392 | 4.658 | 10.523.565 | (4.833.275) |
| (8.942) | (9.225) | (545) | (423) | (4.819) | (2.525) | (658.434) | (715.865) |
| (466) | (382) | 0 | 0 | (58) | (52) | (13.909) | (11.406) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (17.976) | (19.457) |
| (2) | (2) | (5) | (4) | (2) | (1) | (2.631) | (2.951) |
| (9.410) | (9.609) | (550) | (427) | (4.879) | (2.578) | (692.950) | (749.679) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 69 | 68 | 6.354 | 5.380 |
| (9.410) | (9.609) | (550) | (427) | (4.810) | (2.510) | (686.596) | (744.299) |
| 247.487 | (36.281) | 21.401 | (7.806) | 28.582 | 2.148 | 9.836.969 | (5.577.574) |
| (496) | (158) | (625) | (183) | (2.478) | (473) | (164.745) | (105.122) |
| (265) | (416) | 0 | 0 | 0 | 0 | (641) | (1.276) |
| (20.219) | (19.204) | (1.293) | (2.114) | (11.790) | (8.518) | (1.010.532) | (1.071.897) |
| 909 | 150 | 145 | 42 | (12) | 141 | 30.920 | (8.124) |
| (20.071) | (19.628) | (1.773) | (2.255) | (14.280) | (8.850) | (1.144.998) | (1.186.419) |
| 227.416 | (55.909) | 19.628 | (10.061) | 14.302 | (6.702) | 8.691.971 | (6.763.993) |
| 0 | (148) | 0 | (3) | 0 | 1 | (5.168) | (8.134) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | (2) | (246) | (997) |
| 227.416 | (56.057) | 19.628 | (10.064) | 14.302 | (6.703) | 8.686.557 | (6.773.124) |
| $ 227.416 | $ (56.057) | $ 19.628 | $ (10.064) | $ 14.302 | $ (6.703) | $ 8.686.557 | $ (6.773.124) |

# Ausweis der Nettovermögensänderungen

| (Angaben in Tausend) | PIMCO Asia High Yield Bond Fund | PIMCO Capital Securities Fund | | Commodity Real Return Fund | |
|---|---|---|---|---|---|
| | Berichtszeitraum vom 14. Feb. 2019 bis 30. Juni 2019 | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 0 | $ 5.998.728 | $ 8.731.253 | $ 521.092 | $ 518.533 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 137.406 | 1.508.126 | 1.938.219 | 92.831 | 199.710 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 7 | 4.097 | 4.073 | 0 | 0 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | 0 | (1.135.597) | (2.435.535) | (113.555) | (73.538) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 3.797 | 482.645 | (495.059) | 37.246 | (6.182) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 141.210 | $ 6.857.999 | $ 7.742.951 | $ 537.614 | $ 638.523 |

| | Dynamic Multi-Asset Fund | | Emerging Asia Bond Fund | | Emerging Local Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | € 1.187.964 | € 1.033.781 | $ 33.569 | $ 39.966 | $ 2.281.384 | $ 3.008.766 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 359.217 | 355.933 | 6.649 | 3.753 | 501.355 | 762.334 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 0 | 15 | 7 | 9 | 1.912 | 1.992 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (255.118) | (206.376) | (6.982) | (6.054) | (525.465) | (1.178.264) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 57.531 | (18.187) | 2.365 | (1.817) | 215.919 | (238.638) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | € 1.349.594 | € 1.165.166 | $ 35.608 | $ 35.857 | $ 2.475.105 | $ 2.356.190 |

| | Euro Bond Fund | | Euro Credit Fund | | Euro Income Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | € 1.978.440 | € 1.264.884 | € 742.058 | € 774.565 | € 1.487.943 | € 1.046.201 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 552.370 | 358.153 | 262.830 | 160.142 | 1.012.930 | 582.228 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 0 | 1 | 0 | 76 | 152 | 30 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (169.051) | (150.685) | (83.921) | (237.562) | (352.971) | (198.084) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 132.607 | 8.217 | 44.013 | (1.084) | 67.433 | (22.272) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | € 2.494.366 | € 1.480.570 | € 964.980 | € 696.137 | € 2.215.487 | € 1.408.103 |

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

| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | | Diversified Income Fund | | Diversified Income Duration Hedged Fund | | Dynamic Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 141.586 | $ 288.667 | $ 6.819.035 | $ 7.918.902 | $ 1.273.910 | $ 1.258.972 | $ 3.087.145 | $ 2.525.901 |
| 11.924 | 23.199 | 2.320.415 | 673.157 | 230.650 | 330.183 | 1.136.854 | 562.066 |
| 5 | 84 | 8.555 | 4.513 | 118 | 374 | 3.034 | 989 |
| (13.531) | (121.341) | (1.069.572) | (1.155.814) | (187.147) | (206.593) | (317.757) | (694.251) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 7.076 | (7.627) | 561.243 | (441.750) | 56.185 | (59.698) | 76.506 | (49.812) |
| $ 147.060 | $ 182.982 | $ 8.639.676 | $ 6.999.008 | $ 1.373.716 | $ 1.323.238 | $ 3.985.782 | $ 2.344.893 |

| Emerging Markets Bond Fund | | Emerging Markets Corporate Bond Fund | | PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Berichtszeitraum vom 04. Juni 2019 bis 30. Juni 2019 | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 2.428.290 | $ 3.324.965 | $ 194.608 | $ 233.998 | $ 0 | $ 51.799 | $ 44.882 |
| 1.923.882 | 737.887 | 58.184 | 21.033 | 124.057 | 24.662 | 21.691 |
| 3.743 | 1.256 | 109 | 95 | 0 | 0 | 7 |
| (863.487) | (1.168.589) | (34.184) | (42.740) | 0 | (8.787) | (6.883) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 259.493 | (251.365) | 15.559 | (13.036) | 4.380 | 2.662 | (2.824) |
| $ 3.751.921 | $ 2.644.154 | $ 234.276 | $ 199.350 | $ 128.437 | $ 70.336 | $ 56.873 |

| Euro Long Average Duration Fund | | Euro Low Duration Fund | | Euro Short-Term Fund | | Global Advantage Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| € 253.994 | € 254.382 | € 313.942 | € 434.279 | € 775.039 | € 1.458.614 | $ 731.946 | $ 789.081 |
| 47.702 | 28.666 | 102.309 | 404.067 | 145.021 | 173.710 | 113.438 | 26.470 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 88 | 1.483 | 1.124 |
| (49.011) | (56.602) | (84.200) | (158.415) | (208.190) | (560.973) | (84.215) | (41.922) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 39.274 | 8.153 | 3.226 | (3.952) | 831 | (12.690) | 39.132 | (28.228) |
| € 291.959 | € 234.599 | € 335.277 | € 675.979 | € 712.701 | € 1.058.749 | $ 801.784 | $ 746.525 |

# Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | Global Advantage Real Return Fund | | Global Bond Fund | | Global Bond ESG Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 87.854 | $ 126.444 | $ 10.900.009 | $ 10.419.008 | $ 506.382 | $ 286.096 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 26.222 | 2.184 | 4.092.991 | 2.172.038 | 188.834 | 173.137 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 170 | 298 | 4.966 | 2.610 | 502 | 254 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (42.213) | (21.012) | (1.695.579) | (1.785.508) | (48.582) | (5.529) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 5.114 | (6.475) | 629.884 | (219.502) | 30.360 | (12.996) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 77.147 | $ 101.439 | $ 13.932.271 | $ 10.588.646 | $ 677.496 | $ 440.962 |

| | Global Libor Plus Bond Fund | | Global Low Duration Real Return Fund | | Global Multi-Asset Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 1.039.498 | $ 540.876 | $ 1.154.274 | $ 2.197.467 | $ 850.423 | $ 1.066.739 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 678.783 | 331.209 | 213.942 | 553.293 | 75.354 | 124.541 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 594 | 120 | 38 | 99 | 7 | 13 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (171.866) | (177.492) | (273.397) | (1.146.412) | (133.217) | (136.249) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 21.409 | (26.853) | 24.779 | (47.263) | 70.030 | (28.124) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 1.568.418 | $ 667.860 | $ 1.119.636 | $ 1.557.184 | $ 862.597 | $ 1.026.920 |

| | Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | | Low Duration Income Fund | | PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Berichtszeitraum vom 31. Mai 2018 bis 30. Juni 2018 | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 526.200 | $ 628.973 | $ 377.768 | $ 0 | $ 246.190 | $ 379.335 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 18.094 | 81.480 | 30.517 | 356.630 | 130.114 | 266.450 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 0 | 0 | 13 | 0 | 247 | 249 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (40.660) | (131.147) | (16.823) | 0 | (153.315) | (383.875) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 14.433 | (21.159) | 11.019 | (512) | 33.964 | (2.133) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 518.067 | $ 558.147 | $ 402.494 | $ 356.118 | $ 257.200 | $ 260.026 |

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

(1) Der Global Investment Grade Credit ESG Fund wurde am 28. September 2018 aufgelegt.

| Global Bond Ex-US Fund | | Global High Yield Bond Fund | | Global Investment Grade Credit Fund | | Global Investment Grade Credit ESG Fund[1] |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 963.225 | $ 931.240 | $ 3.153.872 | $ 5.349.958 | $ 17.244.136 | $ 20.741.806 | $ 42.731 |
| 152.447 | 198.089 | 1.257.082 | 1.108.877 | 5.800.024 | 4.459.202 | 28.881 |
| 1.097 | 385 | 3.125 | 3.297 | 10.608 | 9.647 | 0 |
| (200.739) | (143.258) | (897.570) | (2.259.860) | (4.340.893) | (5.310.951) | (1.759) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 50.945 | 11.079 | 266.784 | (173.650) | 1.235.273 | (909.994) | 3.916 |
| $ 966.975 | $ 997.535 | $ 3.783.293 | $ 4.028.622 | $ 19.949.148 | $ 18.989.710 | $ 73.769 |

| Global Real Return Fund | | Income Fund | | Inflation Strategy Fund | | Low Average Duration Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 1.947.570 | $ 2.197.667 | $ 55.918.429 | $ 72.274.750 | $ 76.181 | $ 89.502 | $ 1.221.290 | $ 1.733.028 |
| 399.409 | 736.894 | 27.617.205 | 21.266.193 | 22.306 | 22.047 | 291.471 | 429.941 |
| 406 | 772 | 31.253 | 28.967 | 0 | 0 | 164 | 1.503 |
| (365.802) | (651.357) | (13.115.171) | (24.875.639) | (34.753) | (17.609) | (426.646) | (707.197) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 119.422 | (55.577) | 2.789.848 | (3.093.710) | 7.441 | (3.706) | 28.527 | (28.992) |
| $ 2.101.005 | $ 2.228.399 | $ 73.241.564 | $ 65.600.561 | $ 71.175 | $ 90.234 | $ 1.114.806 | $ 1.428.283 |

| Mortgage Opportunities Fund | | PIMCO RAE Emerging Markets Fund | | PIMCO RAE Europe Fund | | PIMCO RAE Global Developed Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 2.183.029 | $ 1.484.592 | $ 94.740 | $ 82.721 | € 8.125 | € 13.813 | $ 31.939 | $ 103.100 |
| 361.882 | 1.427.945 | 61.060 | 16.583 | 2.862 | 7.098 | 18.480 | 12.695 |
| 1.730 | 1.518 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (941.821) | (495.770) | (47.073) | (29.192) | (4.287) | (2.883) | (3.001) | (43.565) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 26.938 | (50.762) | 8.940 | (4.655) | 777 | (664) | 4.230 | (604) |
| $ 1.631.758 | $ 2.367.523 | $ 117.667 | $ 65.457 | € 7.477 | € 17.364 | $ 51.648 | $ 71.626 |

# Ausweis der Nettovermögensänderungen (Forts.)

| (Angaben in Tausend) | PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | | PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | | PIMCO RAE PLUS US Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Berichtszeitraum vom 01. Jan. 2019 bis 05. Juni 2019 | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 33.392 | $ 83.679 | $ 217.558 | $ 421.968 | $ 123.755 | $ 149.038 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 4.005 | 27.355 | 21.654 | 28.594 | 968 | 14.624 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 0 | 0 | 0 | 80 | 0 | 0 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (15.470) | (56.070) | (73.881) | (189.395) | (131.812) | (37.299) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 2.447 | (4.567) | 20.039 | (10.345) | 7.089 | 760 |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 24.374 | $ 50.397 | $ 185.370 | $ 250.902 | $ 0 | $ 127.123 |

| | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund[5] | Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | | StocksPLUS™ Fund | |
|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | $ 2.727 | $ 548.383 | $ 511.888 | $ 2.299.203 | $ 1.695.478 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 0 | 145.106 | 128.600 | 1.024.378 | 982.101 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 0 | 0 | 1.828 | 60 | 0 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | 0 | (64.505) | (52.283) | (847.355) | (701.382) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 436 | 51.940 | (43.752) | 451.118 | 13.945 |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | $ 3.163 | $ 680.924 | $ 546.281 | $ 2.927.404 | $ 1.990.142 |

| | UK Corporate Bond Fund | | UK Long Term Corporate Bond Fund | | US High Yield Bond Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| **Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums** | £ 386.886 | £ 480.675 | £ 372.630 | £ 434.641 | $ 2.496.388 | $ 3.014.320 |
| Erlöse aus ausgegebenen Anteilen und Aufrechnungen | 112.719 | 44.575 | 36.577 | 86.855 | 762.252 | 586.018 |
| Erlöse aus Wiederanlagen von Ausschüttungen | 1 | 0 | 650 | 0 | 5.355 | 5.324 |
| Zahlungen für zurückgenommene Anteile | (99.872) | (80.632) | (21.243) | (84.726) | (596.698) | (766.732) |
| Nominalwechselkursanpassungen | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens der rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhaber aus der Geschäftstätigkeit | 25.657 | (10.318) | 36.957 | (10.694) | 227.416 | (56.057) |
| **Nettovermögen zum Ende des Berichtszeitraums** | £ 425.391 | £ 434.300 | £ 425.571 | £ 426.076 | $ 2.894.713 | $ 2.782.873 |

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

(2) Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund wurde am 16. November 2018 aufgelegt.

(3) Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund wurde am 16. November 2018 aufgelegt.

(4) Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund wurde am 16. November 2018 aufgelegt.

(5) Der PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund wurde am 16. November 2018 aufgelegt.

* Die Summe der Gesellschaft für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2019 und zum 30. Juni 2018 wurde bereinigt, um Überkreuzinvestitionen Rechnung zu tragen. Nähere Einzelheiten hierzu sind Erläuterung 10 in den Erläuterungen zum Abschluss zu entnehmen.

| PIMCO RAE US Fund | | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund[2] | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund[3] | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund[4] |
|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 11.525 | $ 14.083 | 9.889 $ | € 4.104 | 4.623 $ |
| 728 | 1.099 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (744) | (1.466) | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1.554 | 90 | 994 | 579 | 663 |
| $ 13.063 | $ 13.806 | 10.883 $ | € 4.683 | 5.286 $ |

| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Strategic Income Fund | | Total Return Bond Fund | | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Berichtszeitraum vom 29. März 2019 bis 30. Juni 2019 | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| 0 $ | $ 899.132 | $ 785.534 | $ 4.899.730 | $ 6.394.519 | $ 51.842 | $ 134.029 |
| 5.000 | 195.123 | 248.227 | 580.028 | 690.345 | 8.385 | 31.195 |
| 0 | 6 | 11 | 5.414 | 3.612 | 6 | 25 |
| 0 | (66.357) | (64.678) | (840.343) | (1.109.100) | (28.966) | (34.754) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 268 | 49.628 | (49.173) | 242.759 | (245.072) | (825) | (7.699) |
| 5.268 $ | $ 1.077.532 | $ 919.921 | $ 4.887.588 | $ 5.734.304 | $ 30.442 | $ 122.796 |

| US Investment Grade Corporate Bond Fund | | US Short-Term Fund | | Summe der Gesellschaft* | |
|---|---|---|---|---|---|
| Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Juni 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
| $ 178.732 | $ 159.790 | $ 2.650.419 | $ 1.372.039 | $ 144.323.640 | $ 172.099.099 |
| 135.032 | 52.336 | 1.008.955 | 856.767 | 56.265.273 | 45.267.652 |
| 19 | 35 | 11.790 | 8.518 | 101.647 | 83.935 |
| (44.934) | (24.379) | (1.272.405) | (391.470) | (32.736.097) | (51.020.192) |
| 0 | 0 | 0 | 0 | (16.040) | (250.646) |
| 19.628 | (10.064) | 14.302 | (6.703) | 8.686.557 | (6.773.124) |
| $ 288.477 | $ 177.718 | $ 2.413.061 | $ 1.839.151 | $ 176.624.980 | $ 159.406.724 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barminco Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2022 | $ | 300 | $ 310 | 0,22 |
| **Mineral Resources Ltd.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 01.05.2027 | | 400 | 417 | 0,30 |
| **Optus Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.06.2029 | € | 1.200 | 1.387 | 0,98 |
| **Santos Finance Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 13.03.2029 | $ | 1.300 | 1.361 | 0,96 |
| Summe Australien | | | 3.475 | 2,46 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.02.2023 | HKD | 16.000 | 1.922 | 1,36 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **21Vianet Group, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2021 | $ | 2.000 | 2.063 | 1,46 |
| **Agile Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,700 % fällig am 07.03.2022 | | 800 | 824 | 0,58 |
| **CAR, Inc.** | | | | |
| 8,875 % fällig am 10.05.2022 | | 400 | 401 | 0,28 |
| **Central China Real Estate Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 24.04.2023 | | 1.300 | 1.285 | 0,91 |
| **Champion Sincerity Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 08.02.2022 (d) | | 400 | 419 | 0,30 |
| **China Aoyuan Group Ltd.** | | | | |
| 7,950 % fällig am 07.09.2021 | | 1.600 | 1.674 | 1,19 |
| 8,500 % fällig am 23.01.2022 | | 200 | 211 | 0,15 |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 6,250 % fällig am 28.06.2021 | | 900 | 866 | 0,61 |
| 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 3.950 | 3.818 | 2,70 |
| 9,500 % fällig am 11.04.2022 | | 200 | 199 | 0,14 |
| **China SCE Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 10.03.2022 | | 800 | 790 | 0,56 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 23.01.2022 (g) | | 1.600 | 1.589 | 1,13 |
| 6,875 % fällig am 23.04.2021 | | 200 | 205 | 0,15 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 17.01.2023 | | 1.100 | 1.079 | 0,76 |
| 7,125 % fällig am 25.04.2022 | | 300 | 317 | 0,23 |
| **eHi Car Services Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 14.08.2022 | | 200 | 183 | 0,13 |
| **Fantasia Holdings Group Co. Ltd.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 04.10.2021 | | 800 | 734 | 0,52 |
| **Future Land Development Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,150 % fällig am 15.04.2023 | | 1.200 | 1.186 | 0,84 |
| **Global A&T Electronics Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 12.01.2023 | | 200 | 188 | 0,13 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 30.06.2022 | | 3.500 | 3.344 | 2,37 |
| **KWG Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 11.01.2022 | | 600 | 598 | 0,42 |
| **Logan Property Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 24.04.2021 | | 600 | 614 | 0,44 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2024 | | 700 | 719 | 0,51 |
| **Modern Land China Co. Ltd.** | | | | |
| 7,950 % fällig am 05.03.2021 | | 200 | 186 | 0,13 |
| **Ronshine China Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 01.02.2021 | | 200 | 204 | 0,14 |
| 10,500 % fällig am 01.03.2022 | | 800 | 835 | 0,59 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 | | 1.600 | 1.601 | 1,13 |
| 7,875 % fällig am 15.02.2022 | | 900 | 918 | 0,65 |
| 7,950 % fällig am 08.08.2022 | | 800 | 817 | 0,58 |
| **Times China Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 17.01.2021 | | 2.100 | 2.116 | 1,50 |
| **VLL International, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 28.11.2024 | | 1.925 | 1.950 | 1,38 |
| **WTT Investment Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 21.11.2022 | $ | 1.700 | $ 1.762 | 1,25 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 1.100 | 1.081 | 0,77 |
| **Xinyuan Real Estate Co. Ltd.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 28.02.2021 | | 200 | 183 | 0,13 |
| **Yingde Gases Investment Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 19.01.2023 | | 1.900 | 1.934 | 1,37 |
| **Yuzhou Properties Co. Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2022 | | 300 | 296 | 0,21 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2023 | | 1.200 | 1.131 | 0,80 |
| | | | 38.320 | 27,14 |
| Summe Cayman Inseln | | | 40.242 | 28,50 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CFLD Cayman Investment Ltd.** | | | | |
| 8,625 % fällig am 28.02.2021 | | 2.200 | 2.288 | 1,62 |
| **Greenland Global Investment Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 03.07.2024 | | 700 | 665 | 0,47 |
| **New Metro Global Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 08.08.2022 | | 500 | 487 | 0,34 |
| **Overseas Chinese Town Asia Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 10.10.2020 (d) | | 1.600 | 1.599 | 1,13 |
| **Proven Honour Capital Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 06.05.2026 | | 2.000 | 2.002 | 1,42 |
| **Tewoo Group Finance No. 3 Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 06.04.2022 | | 400 | 242 | 0,17 |
| **Tsinghua Unic Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 31.01.2023 | | 1.600 | 1.536 | 1,09 |
| **Weichai International Hong Kong Energy Group Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 14.09.2022 (d) | | 600 | 590 | 0,42 |
| **Yankuang Group Cayman Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.11.2020 | | 800 | 799 | 0,57 |
| **Zoomlion HK SPV Co. Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 20.12.2022 | | 1.900 | 1.900 | 1,34 |
| Summe China | | | 12.108 | 8,57 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | | |
| **Shanghai Port Group BVI Holding Co. Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 09.08.2022 (c) | | 1.450 | 1.474 | 1,04 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of East Asia Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 02.12.2020 (d)(f) | | 900 | 901 | 0,64 |
| 5,625 % fällig am 18.05.2022 (d)(f) | | 200 | 200 | 0,14 |
| **Bright Food Singapore Holdings Pte Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 19.06.2024 | € | 1.300 | 1.498 | 1,06 |
| **Easy Tactic Ltd.** | | | | |
| 9,125 % fällig am 28.07.2022 | $ | 500 | 531 | 0,38 |
| **Far East Horizon Ltd.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 14.06.2022 (d) | | 1.550 | 1.496 | 1,06 |
| **Fortune Star BVI Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 23.03.2022 | | 1.800 | 1.784 | 1,26 |
| **Franshion Brilliant Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 17.01.2022 (d) | | 1.600 | 1.529 | 1,08 |
| **GLP China Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,974 % fällig am 26.02.2024 | | 200 | 210 | 0,15 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 07.11.2022 (d) | | 400 | 392 | 0,28 |
| **Lenovo Group Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.03.2023 | | 400 | 404 | 0,29 |
| **Nanyang Commercial Bank Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 02.06.2022 (d)(f) | | 200 | 195 | 0,14 |
| **Nuoxi Capital Ltd.** | | | | |
| 5,350 % fällig am 24.01.2023 | | 400 | 357 | 0,25 |
| | | | 9.497 | 6,73 |
| Summe Hongkong | | | 10.971 | 7,77 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Green Energy UP Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.12.2024 | | 700 | 716 | 0,51 |
| **Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 03.07.2029 (a) | $ | 600 | $ 609 | 0,43 |
| **Delhi International Airport Ltd.** | | | | |
| 6,450 % fällig am 04.06.2029 | | 1.700 | 1.795 | 1,27 |
| **GMR Hyderabad International Airport Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 10.04.2024 | | 1.700 | 1.726 | 1,22 |
| **JSW Steel Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 13.04.2022 | | 600 | 617 | 0,44 |
| 5,950 % fällig am 18.04.2024 | | 200 | 207 | 0,15 |
| **ReNew Power Synthetic** | | | | |
| 6,670 % fällig am 12.03.2024 | | 1.500 | 1.535 | 1,09 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 24.10.2022 | | 1.100 | 1.119 | 0,79 |
| Summe Indien | | | 8.324 | 5,90 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank Mandiri Persero Tbk PT** | | | | |
| 3,750 % fällig am 11.04.2024 | | 400 | 408 | 0,29 |
| **Bukit Makmur Mandiri Utama PT** | | | | |
| 7,750 % fällig am 13.02.2022 | | 400 | 414 | 0,29 |
| **Indonesia Asahan Aluminium Persero PT** | | | | |
| 6,530 % fällig am 15.11.2028 | | 200 | 236 | 0,17 |
| **LLPL Capital Pte Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 04.02.2039 | | 200 | 229 | 0,16 |
| **Medco Oak Tree Pte Ltd.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 14.05.2026 | | 1.600 | 1.611 | 1,14 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 6,500 % fällig am 07.11.2048 | | 200 | 248 | 0,18 |
| **Saka Energi Indonesia PT** | | | | |
| 4,450 % fällig am 05.05.2024 | | 800 | 807 | 0,57 |
| | | | 3.953 | 2,80 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.03.2034 | IDR | 5.300.000 | 399 | 0,28 |
| 8,750 % fällig am 15.02.2044 | | 4.500.000 | 335 | 0,24 |
| | | | 734 | 0,52 |
| Summe Indonesien | | | 4.687 | 3,32 |
| | | **ANZAHL** | | |
| **IRELAND** | | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (e)** | | 8.100 | 822 | 0,58 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Asahi Mutual Life Insurance Co.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 05.09.2023 (d) | $ | 500 | 522 | 0,37 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 1.500 | 1.624 | 1,15 |
| **Dream Global Funding SARL** | | | | |
| 1,750 % fällig am 28.06.2026 | € | 700 | 806 | 0,57 |
| Summe Luxemburg | | | 2.430 | 1,72 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Malaysia Government International Bond** | | | | |
| 4,921 % fällig am 06.07.2048 | MYR | 6.700 | 1.780 | 1,26 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Azure Power Energy Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 03.11.2022 | $ | 400 | 405 | 0,29 |
| **Greenko Investment Co.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.08.2023 | | 1.700 | 1.657 | 1,17 |
| Summe Mauritius | | | 2.062 | 1,46 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Trust F** | | | | |
| 4,869 % fällig am 15.01.2030 | $ | 700 | $ 706 | 0,50 |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 700 | 719 | 0,51 |
| Summe Mexiko | | | 1.425 | 1,01 |
| **MONGOLEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mongolia Government International Bond** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.05.2023 | | 2.500 | 2.548 | 1,80 |
| **PAKISTAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Pakistan Government International Bond** | | | | |
| 6,875 % fällig am 05.12.2027 | | 2.500 | 2.532 | 1,79 |
| 8,250 % fällig am 15.04.2024 | | 200 | 219 | 0,16 |
| Summe Pakistan | | | 2.751 | 1,95 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Royal Capital BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 05.05.2024 (d) | | 1.800 | 1.793 | 1,27 |
| 5,500 % fällig am 05.05.2021 (d) | | 400 | 410 | 0,29 |
| | | | 2.203 | 1,56 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Philippines Government International Bond** | | | | |
| 6,250 % fällig am 14.01.2036 | PHP | 40.000 | 896 | 0,63 |
| Summe Philippinen | | | 3.099 | 2,19 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABJA Investment Co. Pte. Ltd.** | | | | |
| 5,450 % fällig am 24.01.2028 | $ | 1.500 | 1.440 | 1,02 |
| **Alam Synergy Pte Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 24.04.2022 | | 200 | 196 | 0,14 |
| **Eterna Capital Pte Ltd. (8,000 % bar oder 8,000 % PIK)** | | | | |
| 8,000 % fällig am 11.12.2022 (b) | | 800 | 669 | 0,47 |
| **Global Prime Capital Pte Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 26.04.2021 | | 200 | 208 | 0,15 |
| **Indika Energy Capital Pte. Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 09.11.2024 | | 900 | 883 | 0,63 |
| **Theta Capital Pte Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 31.10.2026 | $ | 600 | $ 551 | 0,39 |
| Summe Singapur | | | 3.947 | 2,80 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Shinhan Financial Group Co. Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 13.08.2023 (d)(f) | | 1.500 | 1.596 | 1,13 |
| **Woori Bank** | | | | |
| 5,250 % fällig am 16.05.2022 (d)(f) | | 1.100 | 1.121 | 0,79 |
| Summe Südkorea | | | 2.717 | 1,92 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (d)(f) | € | 1.000 | 1.173 | 0,83 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.04.2023 | $ | 1.900 | 1.887 | 1,34 |
| 6,125 % fällig am 03.06.2025 | | 3.050 | 2.979 | 2,11 |
| 6,200 % fällig am 11.05.2027 | | 2.650 | 2.517 | 1,78 |
| 6,825 % fällig am 18.07.2026 | | 300 | 300 | 0,21 |
| Summe Sri Lanka | | | 7.683 | 5,44 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADES International Holding PLC** | | | | |
| 8,625 % fällig am 24.04.2024 | | 400 | 397 | 0,28 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (d)(f) | € | 400 | 461 | 0,33 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (d)(f) | | 600 | 741 | 0,52 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (d)(f) | $ | 1.150 | 1.182 | 0,84 |
| **Vedanta Resources Finance PLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 23.04.2023 | | 800 | 812 | 0,57 |
| **Vedanta Resources Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 09.08.2024 | | 2.200 | 2.030 | 1,44 |
| Summe Großbritannien | | | 5.226 | 3,70 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **1MDB Global Investments Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 09.03.2023 | $ | 1.000 | $ 951 | 0,67 |
| **Baoxin Auto Finance Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 30.10.2020 (d) | | 500 | 451 | 0,32 |
| **Celestial Dynasty Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 27.06.2029 | | 1.200 | 1.213 | 0,86 |
| **Celestial Miles Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.01.2024 (d) | | 2.200 | 2.306 | 1,63 |
| **Easy Tactic Ltd.** | | | | |
| 8,625 % fällig am 27.02.2024 | | 2.500 | 2.546 | 1,80 |
| **NWD Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 05.10.2021 (d) | | 1.300 | 1.305 | 0,93 |
| **RKPF Overseas 2019 A Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.02.2023 | | 1.500 | 1.578 | 1,12 |
| **RKPF Overseas 2019 B Ltd.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 18.04.2021 | | 300 | 314 | 0,22 |
| **Scenery Journey Ltd.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 06.03.2021 | | 300 | 298 | 0,21 |
| 13,750 % fällig am 06.11.2023 | | 700 | 748 | 0,53 |
| **Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.04.2033 | | 1.820 | 1.838 | 1,30 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 11.02.2024 | | 1.700 | 1.773 | 1,26 |
| Summe Jungferninseln (Britisch) | | | 15.321 | 10,85 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (h)** | | | | |
| | | | 1.718 | 1,22 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 1.718 | 1,22 |

| ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS | ANZAHL | | |
|---|---|---|---|
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)** | 446.354 | 4.470 | 3,17 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 139.898** | **99,07** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 4 | $ (8) | (0,01) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 172,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 7 | (5) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 174,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 6 | 0 | 0,00 |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09/2019 | 8 | (3) | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 5 | (17) | (0,01) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 168,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 4 | 2 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 7 | 2 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 6 | 0 | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 5 | (2) | 0,00 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 28 | (37) | (0,03) |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 1 | 4 | 0,00 |
| | | | | $ (64) | (0,05) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (64)** | **(0,05)** |

[1] Future-Style-Option.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Asia High Yield 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**

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,230 % | 15.05.2024 | $ 100 | $ (2) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,270 | 06.06.2024 | 200 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 15.05.2024 | 100 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 22.05.2024 | 100 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,310 | 24.05.2024 | 100 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,320 | 21.05.2024 | 100 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,330 | 20.05.2024 | 100 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,410 | 28.03.2024 | 100 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2049 | 650 | (90) | (0,07) |
| | | | | | $ (114) | (0,08) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (114)** | **(0,08)** |

**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 | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,790 % | 11.07.2019 | 300 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,070 | 11.07.2019 | 300 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (1) | $ (1) | 0,00 |

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | South Korea Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 2.950 | $ (93) | $ 1 | $ (92) | (0,07) |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2024 | 11.900 | (384) | (3) | (387) | (0,27) |
| | | | | | $ (477) | $ (2) | $ (479) | (0,34) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Tencent Holdings Ltd. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 550 | $ 6 | $ (2) | $ 4 | 0,00 |
| CBK | Alibaba Group Holding Ltd. | 1,000 | 20.06.2024 | 550 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | Sinopec Group Overseas Development Ltd. | 1,000 | 20.06.2024 | 550 | 8 | (1) | 7 | 0,01 |
| | | | | | $ 20 | $ (3) | $ 17 | 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 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.

**ZINSSWAPS**

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 3,135 % | 06.05.2024 | CNY 8.500 | $ 0 | $ 13 | $ 13 | 0,01 |
| MYI | Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 3,200 | 19.06.2024 | 7.400 | 0 | 16 | 16 | 0,01 |
| SCX | Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 3,246 | 19.06.2024 | 4.200 | 5 | 5 | 10 | 0,01 |
| | | | | | | $ 5 | $ 34 | $ 39 | 0,03 |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 08/2019 | € | 2.105 | $ | 2.384 | $ 0 | $ (21) | $ (21) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 1.391 | ¥ | 151.200 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | | 1.395 | | 151.415 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| BRC | 09/2019 | MYR | 7.405 | $ | 1.787 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| CBK | 08/2019 | € | 4.143 | | 4.663 | 0 | (71) | (71) | (0,05) |
| | 08/2019 | $ | 1.106 | € | 971 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 258 | £ | 203 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 09/2019 | KRW | 1.636.012 | $ | 1.382 | 0 | (38) | (38) | (0,03) |
| | 09/2019 | $ | 1.389 | KRW | 1.609.616 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | ¥ | 151.415 | $ | 1.407 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.410 | ¥ | 151.415 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 15.324 | $ | 1.958 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 57.792 | | 1.846 | 0 | (29) | (29) | (0,02) |
| JPM | 08/2019 | £ | 203 | | 266 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 28.633 | | 913 | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| | | | | | | $ 49 | $ (184) | $ (135) | (0,09) |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 132 | SGD | 182 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | SGD | 92 | $ | 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 67 | SGD | 92 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 68 | | 93 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 67 | | 91 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | SGD | 93 | $ | 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 69 | SGD | 93 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SGD | 91 | $ | 67 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 68 | SGD | 92 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SGD | 92 | $ | 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 66 | SGD | 89 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 2 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 5 | $ 0 | $ 5 | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ (554)** | **(0,39)** |
| **Summe Anlagen** | **$ 139.166** | **98,55** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 2.044** | **1,45** |
| **Nettovermögen** | **$ 141.210** | **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 USD 171 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 270 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(g) Beschränkte Wertpapiere:**

| Emittent Beschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Erwerbsdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| CIFI Holdings Group Co. Ltd. | 5,500 % | 23.01.2022 | 16.04.2019 | $ 1.571 | $ 1.589 | 1,13 |

**(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 1,350 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 1.718 | U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021 | $ (1.755) | $ 1.718 | $ 1.718 | 1,22 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.755)** | **$ 1.718** | **$ 1.718** | **1,22** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 5.292 | $ 134.606 | $ 0 | $ 139.898 |
| Finanzderivate[3] | (64) | (668) | 0 | (732) |
| **Summen** | **$ 5.228** | **$ 133.938** | **$ 0** | **$ 139.166** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (2) | $ 0 | $ (2) |
| BPS | 16 | 0 | 16 |
| BRC | (482) | 270 | (212) |
| CBK | (52) | 0 | (52) |
| GLM | (31) | 0 | (31) |
| HUS | (33) | 0 | (33) |
| JPM | 4 | 0 | 4 |
| MYI | 16 | 0 | 16 |
| SCX | 10 | 0 | 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.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) [1] |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 64,45 | k. A. |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 33,40 | k. A. |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 1,22 | k. A. |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,05) | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,08) | k. A. |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,39) | k. A. |

(1) Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund wurde am 14. Februar 2019 aufgelegt.

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.04.2024 (e)(g) | € | 15.800 | $ 20.658 | 0,30 |
| 8,875 % fällig am 15.10.2021 (e)(g) | | 29.200 | 38.241 | 0,56 |
| Summe Österreich | | | 58.899 | 0,86 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (e)(g) | | 132.200 | 147.751 | 2,15 |
| 4,750 % fällig am 05.03.2024 (e)(g)(h) | | 29.800 | 36.050 | 0,53 |
| Summe Belgien | | | 183.801 | 2,68 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | $ | 66.700 | 66.863 | 0,97 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Danske Bank A/S** | | | | |
| 5,875 % fällig am 06.04.2022 (e)(g) | € | 44.286 | 53.354 | 0,78 |
| 7,000 % fällig am 26.06.2025 (e)(g) | $ | 47.000 | 47.846 | 0,70 |
| Summe Dänemark | | | 101.200 | 1,48 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nordea Bank Abp** | | | | |
| 6,625 % fällig am 26.03.2026 (e)(g)(h) | | 40.400 | 42.657 | 0,62 |
| **Sampo OYJ** | | | | |
| 3,375 % fällig am 23.05.2049 | € | 3.100 | 3.784 | 0,06 |
| Summe Finnland | | | 46.441 | 0,68 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 09.01.2025 (h) | $ | 16.900 | 17.207 | 0,25 |
| 3,500 % fällig am 16.11.2027 (h) | | 65.000 | 66.575 | 0,97 |
| 3,800 % fällig am 10.01.2024 (h) | | 36.000 | 37.401 | 0,55 |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 (h) | | 7.800 | 8.458 | 0,12 |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 (h) | | 21.900 | 23.511 | 0,34 |
| 6,069 % fällig am 30.12.2019 (e) | | 5.994 | 6.053 | 0,09 |
| 7,000 % fällig am 16.08.2028 (e)(g)(h) | | 82.900 | 88.571 | 1,29 |
| 7,375 % fällig am 19.08.2025 (e)(g) | | 5.385 | 5.989 | 0,09 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 10.01.2027 (h) | | 45.000 | 47.615 | 0,70 |
| 7,500 % fällig am 23.06.2026 (e)(g)(h) | £ | 83.708 | 121.187 | 1,77 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.01.2027 (h) | $ | 55.000 | 57.112 | 0,83 |
| 6,750 % fällig am 06.04.2028 (e)(g) | | 87.000 | 86.269 | 1,26 |
| 8,000 % fällig am 29.09.2025 (e)(g) | | 28.200 | 31.115 | 0,45 |
| Summe Frankreich | | | 597.063 | 8,71 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | € | 30.000 | 34.687 | 0,51 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 (h) | $ | 49.700 | 51.942 | 0,75 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 (h) | | 15.000 | 16.329 | 0,24 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | 68.271 | 0,99 |
| **IRLAND** | | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (f)** | | 5.850.700 | $ 593.787 | 8,66 |
| | | PARI (000S) | | |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (e)(g) | € | 78.100 | 100.358 | 1,46 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 6,625 % fällig am 03.06.2023 (e)(g) | | 87.145 | 99.047 | 1,44 |
| 6,750 % fällig am 10.09.2021 (e)(g) | | 10.000 | 11.426 | 0,17 |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (e)(g) | | 24.900 | 29.981 | 0,44 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 (h) | $ | 106.000 | 121.171 | 1,77 |
| 9,250 % fällig am 03.06.2022 (e)(g) | € | 31.665 | 40.413 | 0,59 |
| Summe Italien | | | 402.396 | 5,87 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **HBOS Sterling Finance Jersey LP** | | | | |
| 7,881 % fällig am 09.12.2031 (e) | £ | 9.050 | 17.179 | 0,25 |
| **HSBC Bank Capital Funding Sterling LP** | | | | |
| 5,844 % fällig am 05.11.2031 (e) | | 68.382 | 112.571 | 1,64 |
| **HSBC Capital Funding LP** | | | | |
| 10,176 % fällig am 30.06.2030 (e)(h) | $ | 23.667 | 36.809 | 0,54 |
| 10,176 % fällig am 30.06.2030 (e) | | 3.008 | 4.678 | 0,07 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025 | € | 5.400 | 6.371 | 0,09 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 177.608 | 2,59 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.05.2027 | | 18.400 | 21.366 | 0,31 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (c) | | 35.903 | 39.609 | 0,58 |
| Summe Luxemburg | | | 60.975 | 0,89 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.09.2027 (e)(g) | | 12.000 | 14.102 | 0,21 |
| **ASR Nederland NV** | | | | |
| 4,625 % fällig am 19.10.2027 (e)(g) | | 37.000 | 42.746 | 0,62 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 4,625 % fällig am 29.12.2025 (e)(g) | | 16.600 | 20.314 | 0,30 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (e)(g) | | 31.000 | 39.157 | 0,57 |
| 6,910 % fällig am 10.06.2038 (e) | £ | 16.687 | 30.751 | 0,45 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 4,050 % fällig am 09.04.2029 (h) | $ | 20.000 | 21.353 | 0,31 |
| 6,500 % fällig am 16.04.2025 (e)(g) | | 7.700 | 7.989 | 0,12 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 7,375 % fällig am 29.05.2024 (e)(g) | € | 17.900 | 21.512 | 0,31 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (e) | | 33.500 | 42.223 | 0,62 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (e) | | 220.930 | 308.587 | 4,50 |
| **VIVAT NV** | | | | |
| 7,000 % fällig am 19.06.2025 (e)(g) | € | 15.500 | $ 18.766 | 0,27 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 4,625 % fällig am 27.06.2028 (e) | | 43.000 | 52.392 | 0,76 |
| Summe Niederlande | | | 619.892 | 9,04 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 ^ | | 26.300 | 7.338 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^ | | 11.100 | 3.097 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | | 20.000 | 5.580 | 0,08 |
| Summe Portugal | | | 16.015 | 0,23 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Mulhacen Pte. Ltd. (6,500 % bar oder 7,250 % PIK)** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.08.2023 (b) | | 15.000 | 16.484 | 0,24 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Abanca Corp. Bancaria S.A.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 18.01.2029 | | 7.500 | 9.021 | 0,13 |
| 7,500 % fällig am 02.10.2023 (e)(g) | | 17.600 | 20.268 | 0,29 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(g) | | 61.600 | 72.714 | 1,06 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (e)(g) | | 122.600 | 146.939 | 2,14 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (e)(g) | | 99.200 | 116.296 | 1,70 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 3,306 % fällig am 27.06.2029 | $ | 3.800 | 3.832 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 19.03.2025 (e)(g) | € | 5.000 | 5.396 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (e)(g) | | 212.000 | 254.402 | 3,71 |
| **Bankia S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 18.07.2022 (e)(g) | | 58.600 | 68.657 | 1,00 |
| 6,375 % fällig am 19.09.2023 (e)(g) | | 30.400 | 36.374 | 0,53 |
| **Bankinter S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 08.07.2026 (a) | | 23.100 | 26.276 | 0,38 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 23.03.2026 (e)(g) | | 67.000 | 71.860 | 1,05 |
| 6,750 % fällig am 13.06.2024 (e)(g) | | 52.200 | 64.346 | 0,94 |
| Summe Spanien | | | 896.381 | 13,07 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 (h) | $ | 58.700 | 60.564 | 0,88 |
| 4,282 % fällig am 09.01.2028 (h) | | 38.200 | 40.360 | 0,59 |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (e)(g) | | 24.200 | 26.036 | 0,38 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (e)(g) | | 32.700 | 34.949 | 0,51 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (e)(g) | | 20.500 | 22.606 | 0,33 |
| **UBS AG** | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (g) | | 54.167 | 60.781 | 0,89 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 (h) | | 26.700 | 28.519 | 0,42 |
| 5,000 % fällig am 31.01.2023 (e)(g) | | 46.292 | 42.564 | 0,62 |
| 5,750 % fällig am 19.02.2022 (e)(g) | € | 27.495 | 34.530 | 0,50 |
| 6,875 % fällig am 07.08.2025 (e)(g) | $ | 15.000 | 16.080 | 0,23 |
| Summe Schweiz | | | 366.989 | 5,35 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (g) | | 100.520 | 109.828 | 1,60 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 5,088 % fällig am 20.06.2030 | | 6.600 | 6.758 | 0,10 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (e)(g) | £ | 40.500 | 53.928 | 0,79 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (e)(g) | | 29.211 | 38.810 | 0,57 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(g) | $ | 26.200 | 26.874 | 0,39 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (e)(g) | | 45.600 | 47.856 | 0,70 |
| **CYBG PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.09.2026 | £ | 19.500 | 25.022 | 0,36 |
| 7,875 % fällig am 14.12.2028 | | 15.300 | 20.950 | 0,31 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | |
| 2,451 % fällig am 31.12.2019 (e) | $ | 28.930 | 20.496 | 0,30 |
| 2,938 % fällig am 30.09.2019 (e) | | 3.500 | 2.463 | 0,04 |

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

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.07.2029 (e)(g) | € | 111.600 | $ 133.753 | 1,95 |
| 5,875 % fällig am 28.09.2026 (e)(g) | £ | 36.100 | 48.351 | 0,70 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (e)(g) | € | 48.305 | 63.611 | 0,93 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 2,787 % fällig am 29.08.2019 (e) | $ | 4.900 | 3.908 | 0,06 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 6,413 % fällig am 01.10.2035 (e) | | 10.500 | 10.999 | 0,16 |
| 6,657 % fällig am 21.05.2037 (e) | | 7.987 | 8.446 | 0,12 |
| 7,500 % fällig am 27.09.2025 (e)(g) | | 28.800 | 30.301 | 0,44 |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (e)(g) | £ | 68.418 | 95.017 | 1,38 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (e)(g) | | 49.213 | 71.203 | 1,04 |
| **National Westminster Bank PLC** | | | | |
| 1,840 % fällig am 05.10.2019 (e) | € | 13.307 | 15.055 | 0,22 |
| 2,813 % fällig am 28.08.2019 (e) | $ | 21.840 | 17.417 | 0,25 |
| 2,938 % fällig am 14.08.2019 (e) | | 19.240 | 15.344 | 0,22 |
| 3,125 % fällig am 11.01.2020 (e) | | 34.480 | 27.498 | 0,40 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | | 7.200 | 7.537 | 0,11 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.03.2026 | € | 500 | 584 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 21.400 | 25.331 | 0,37 |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | | 11.947 | 14.460 | 0,21 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 (h) | $ | 86.900 | 89.925 | 1,31 |
| 4,445 % fällig am 08.05.2030 | | 11.000 | 11.396 | 0,17 |
| 4,650 % fällig am 30.09.2027 (e) | | 27.200 | 25.976 | 0,38 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 (h) | | 21.600 | 23.124 | 0,34 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 (h) | | 46.326 | 49.509 | 0,72 |
| 7,648 % fällig am 30.09.2031 (e) | | 36.919 | 48.272 | 0,70 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (e)(g) | | 26.678 | 28.819 | 0,42 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (e)(g) | £ | 44.000 | 58.606 | 0,85 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (e)(g) | | 69.950 | 94.759 | 1,38 |
| **TP ICAP PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | | 2.400 | 3.197 | 0,05 |
| **Virgin Money Holdings UK PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2026 | | 6.250 | 8.030 | 0,12 |
| 8,750 % fällig am 10.11.2021 (e)(g) | | 5.440 | 7.455 | 0,11 |
| | | | 1.390.868 | 20,28 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **National Westminster Bank PLC** | | | | |
| 9,000 % | | 500.000 | $ 971 | 0,01 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % | | 672.746 | 129.608 | 1,89 |
| | | | 130.579 | 1,90 |
| Summe Großbritannien | | | 1.521.447 | 22,18 |

| | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|
| **USA** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 3,124 % fällig am 20.01.2023 (h) | $ 95.600 | 97.066 | 1,42 |
| **Citigroup, Inc.** | | | |
| 3,887 % fällig am 10.01.2028 (h) | 26.732 | 28.304 | 0,41 |
| **Dresdner Funding Trust** | | | |
| 8,151 % fällig am 30.06.2031 | 71.095 | 96.032 | 1,40 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | |
| 8,250 % fällig am 15.04.2025 | 1.350 | 1.168 | 0,02 |
| 10,750 % fällig am 01.04.2024 | 300 | 281 | 0,00 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 2,908 % fällig am 05.06.2023 (h) | 28.000 | 28.316 | 0,41 |
| 3,691 % fällig am 05.06.2028 (h) | 62.800 | 64.911 | 0,95 |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 (h) | 10.000 | 10.468 | 0,15 |
| 3,850 % fällig am 26.01.2027 | 20.000 | 20.920 | 0,31 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | |
| 2,776 % fällig am 25.04.2023 (h) | 21.900 | 22.126 | 0,32 |
| 3,220 % fällig am 01.03.2025 (h) | 66.000 | 67.907 | 0,99 |
| **Liberty Mutual Group, Inc.** | | | |
| 3,625 % fällig am 23.05.2059 | € 2.500 | 2.917 | 0,04 |
| **Quicken Loans, Inc.** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | $ 14.000 | 13.982 | 0,20 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **RBS Capital Trust** | | | | |
| 6,425 % fällig am 03.01.2034 (e) | | 39.146 | 50.009 | 0,73 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 22.04.2026 (h) | | 60.000 | 60.709 | 0,89 |
| 3,069 % fällig am 24.01.2023 (h) | | 59.400 | 60.355 | 0,88 |
| Summe USA | | | 625.471 | 9,12 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Bank of Montreal** | | | | |
| 1,800 % fällig am 24.07.2019 | CAD | 200 | $ 153 | 0,00 |
| 1,802 % fällig am 26.07.2019 | | 700 | 535 | 0,01 |
| 1,806 % fällig am 31.07.2019 | | 5.500 | 4.202 | 0,06 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | |
| 1,775 % fällig am 25.07.2019 | | 600 | 459 | 0,01 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 1,777 % fällig am 26.07.2019 | | 2.600 | 1.987 | 0,03 |
| 1,795 % fällig am 31.07.2019 | | 3.200 | 2.445 | 0,03 |
| | | | 9.781 | 0,14 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (i)** | | | | |
| | | | 1.207.398 | 17,61 |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | | |
| 2,359 % fällig am 31.07.2019 (c)(d) | $ | 13.200 | 13.176 | 0,19 |
| 2,376 % fällig am 04.09.2019 (c)(d) | | 4.800 | 4.781 | 0,07 |
| 2,384 % fällig am 19.07.2019 (c)(d) | | 46.500 | 46.449 | 0,68 |
| | | | 64.406 | 0,94 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 1.281.585 | 18,69 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | $ 7.736.255 | 112,81 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 1.366 | $ (5.315) | (0,08) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 3.322 | 8.081 | 0,13 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 190 | 1.705 | 0,02 |
| | | | | $ 4.471 | 0,07 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 4.471** | **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-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | (1,000) % | 20.06.2023 | € 35.000 | $ (960) | (0,01) |
| Banco Santander | (1,000) | 20.06.2024 | 40.000 | (316) | 0,00 |
| Credit Agricole S.A. | (1,000) | 20.06.2023 | 80.000 | (712) | (0,01) |
| Santander International Debt, SAU | (1,000) | 20.06.2023 | 10.000 | (147) | 0,00 |

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Societe Generale | (1,000) % | 20.06.2024 | € 20.000 | $ (77) | 0,00 |
| Societe Generale S.A. | (1,000) | 20.06.2023 | 80.000 | (1.070) | (0,02) |
| UniCredit SpA | (1,000) | 20.06.2023 | 22.600 | (915) | (0,01) |
| UniCredit SpA | (1,000) | 20.12.2023 | 10.000 | (536) | (0,01) |
| UniCredit SpA | (1,000) | 20.06.2024 | 100.000 | (1.828) | (0,03) |
| | | | | $ (6.561) | (0,09) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Deutsche Bank AG | 1,000 % | 20.06.2024 | € 62.000 | $ 1.050 | 0,01 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 1,000 | 20.12.2023 | 34.240 | 1.149 | 0,02 |
| | | | | $ 2.199 | 0,03 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 90.000 | $ 418 | 0,01 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 % | 18.12.2024 | € 119.600 | $ (581) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | 126.000 | (7.105) | (0,11) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | 91.900 | (15.120) | (0,22) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2029 | £ 121.100 | 447 | 0,01 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2029 | 87.600 | (4.146) | (0,06) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 47.000 | (4.826) | (0,07) |
| | | | | | $ (31.331) | (0,46) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (35.275)** | **(0,51)** |

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

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

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

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

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Intesa Sanpaolo SpA | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 19.000 | $ 516 | $ (276) | $ 240 | 0,00 |
| HUS | Intesa Sanpaolo SpA | (1,000) | 20.12.2023 | 20.000 | 513 | (261) | 252 | 0,01 |
| | | | | | $ 1.029 | $ (537) | $ 492 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Banco BPM SpA | 5,000 % | 20.12.2022 | € 10.000 | $ 588 | $ (460) | $ 128 | 0,00 |
| | Banco BPM SpA | 5,000 | 20.06.2023 | 2.800 | (194) | 209 | 15 | 0,00 |
| | Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.06.2024 | 5.000 | 28 | 62 | 90 | 0,00 |
| BRC | Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.06.2024 | 10.000 | 56 | 125 | 181 | 0,01 |
| GST | Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.06.2024 | 10.000 | 56 | 124 | 180 | 0,00 |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| HUS | Deutsche Bank AG | 1,000 % | 20.06.2024 | € 10.000 | $ 61 | $ 119 | $ 180 | 0,00 |
| JPM | Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2023 | 13.100 | (1.829) | 534 | (1.295) | (0,02) |
| | Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.06.2024 | 10.000 | 72 | 108 | 180 | 0,00 |
| | | | | | $ (1.162) | $ 821 | $ (341) | (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.

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Erhalt | SX7E Dividend Swap | 1.094.698 | k. A. | € 5.988 | 20.12.2019 | $ 0 | $ (210) | $ (210) | 0,00 |
| | Erhalt | BNP FP Dividend Swap | 1.614.000 | k. A. | 5.018 | 17.12.2021 | 0 | (858) | (858) | (0,01) |
| JPM | Erhalt | iBoxx EUR Contingent Convertible Liquid Developed Market Index | k. A. | 3-Month EUR-EURIBOR | 25.000 | 20.09.2019 | 12 | 718 | 730 | 0,01 |
| | Erhalt | iBoxx EUR Contingent Convertible Liquid Developed Market Index | k. A. | 3-Month EUR-EURIBOR | 25.000 | 20.12.2019 | 12 | 923 | 935 | 0,01 |
| SOG | Erhalt | GLE FP Dividend SWAP | 3.059.053 | k. A. | 6.661 | 20.12.2019 | 0 | 19 | 19 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 24 | $ 592 | $ 616 | 0,01 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 9.420 | $ | 10.577 | $ 0 | $ (150) | $ (150) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 2.823 | | 3.565 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.261 | € | 1.112 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.903 | £ | 1.498 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € | 22.787 | $ | 25.749 | 10 | (211) | (201) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 34.824 | | 44.397 | 80 | (3) | 77 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.980 | £ | 3.148 | 28 | (2) | 26 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € | 116.402 | $ | 130.183 | 0 | (2.376) | (2.376) | (0,04) |
| | 07/2019 | £ | 10.284 | | 13.080 | 15 | (23) | (8) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CAD | 1.635 | | 1.212 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 6.563 | | 7.469 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 799.025 | | 1.012.402 | 0 | (4.517) | (4.517) | (0,07) |
| | 07/2019 | $ | 26.975 | € | 24.139 | 514 | 0 | 514 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.150.650 | £ | 905.627 | 1.943 | 0 | 1.943 | 0,03 |
| | 08/2019 | £ | 896.372 | $ | 1.140.673 | 0 | (1.916) | (1.916) | (0,03) |
| GLM | 07/2019 | CAD | 3.500 | | 2.670 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 2.726 | | 3.089 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 1.905 | | 2.423 | 1 | (2) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 131.852 | £ | 103.892 | 372 | 0 | 372 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | € | 484 | $ | 551 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 934 | | 1.191 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 209 | € | 184 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 6 | £ | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 212 | SGD | 287 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 540 | $ | 79 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | SEK | 6.170 | | 644 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | CAD | 8.700 | | 6.647 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 58.872 | | 66.509 | 0 | (535) | (535) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 163.834 | | 208.294 | 0 | (218) | (218) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CAD | 600 | | 458 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 36 | | 45 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 538 | HKD | 4.214 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 559 | $ | 701 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 46.444 | € | 41.434 | 741 | 0 | 741 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 665 | SEK | 6.170 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 6.170 | $ | 667 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 2.639 | | 1.936 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | € | 1.962.132 | | 2.194.072 | 0 | (40.405) | (40.405) | (0,59) |
| | | | | | | $ 3.716 | $ (50.520) | $ (46.804) | (0,68) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilklassen Investor AUD (Hedged) ausschüttend und die Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 32.963 | $ | 23.020 | $ 0 | $ (112) | $ (112) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 837 | AUD | 1.206 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 23.044 | | 32.963 | 113 | 0 | 113 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 32.904 | $ | 23.014 | 0 | (76) | (76) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 21.195 | AUD | 30.616 | 290 | 0 | 290 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 23.038 | | 32.904 | 77 | 0 | 77 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 1.425 | | 2.062 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | AUD | 90 | $ | 63 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 323 | AUD | 465 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | | 21.064 | | 30.367 | 246 | 0 | 246 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | AUD | 609 | $ | 425 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 240 | AUD | 344 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | AUD | 100 | $ | 70 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 22.623 | AUD | 32.615 | 265 | 0 | 265 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.027 | $ (192) | $ 835 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | 07/2019 | BRL | 8.314 | $ | 2.176 | $ 6 | $ 0 | $ 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.960 | BRL | 7.929 | 109 | 0 | 109 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 2.169 | | 8.314 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | BRL | 8.314 | $ | 2.175 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.169 | BRL | 8.314 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 52 | | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | BRL | 142 | $ | 36 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.959 | BRL | 7.929 | 110 | 0 | 110 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | BRL | 7.758 | $ | 2.030 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.024 | BRL | 7.758 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | BRL | 200 | $ | 52 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 184 | BRL | 742 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 52 | | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 1.965 | | 7.929 | 104 | 0 | 104 | 0,00 |
| | | | | | | $ 349 | $ (17) | $ 332 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die ausschüttende Investor CAD (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 | 07/2019 | CAD | 164 | $ | 125 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 119 | CAD | 161 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 125 | | 164 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | CAD | 4 | $ | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 165 | | 126 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 120 | CAD | 161 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 125 | | 164 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 3 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 119 | | 160 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | | | $ 14 | $ (2) | $ 12 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CHF | 11 | $ | 11 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 16.172 | CHF | 16.221 | 465 | 0 | 465 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | CHF | 100 | $ | 101 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 16.027 | | 16.367 | 0 | (71) | (71) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 16.180 | CHF | 16.215 | 451 | 0 | 451 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 16.414 | | 16.027 | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 16.155 | | 16.261 | 522 | 0 | 522 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 16.594 | $ | 16.985 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 16.466 | CHF | 16.040 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CHF | 1.087 | $ | 1.093 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 547 | | 557 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 546 | CHF | 540 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.551 | $ (134) | $ 1.417 | 0,02 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | € | 1.017.381 | $ | 1.156.152 | $ 0 | $ (2.441) | $ (2.441) | (0,04) |
| | 08/2019 | $ | 1.159.098 | € | 1.017.381 | 2.456 | 0 | 2.456 | 0,04 |
| BPS | 07/2019 | € | 3.621 | $ | 4.062 | 0 | (61) | (61) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.222 | € | 1.074 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | | 1.108.492 | | 991.077 | 20.147 | 0 | 20.147 | 0,29 |
| CBK | 07/2019 | € | 1.023.980 | $ | 1.163.757 | 0 | (2.352) | (2.352) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 40.400 | € | 35.992 | 599 | (11) | 588 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 1.159.203 | | 1.017.381 | 2.351 | 0 | 2.351 | 0,03 |
| GLM | 07/2019 | | 1.113.584 | | 997.731 | 22.632 | 0 | 22.632 | 0,31 |
| RBC | 07/2019 | € | 2.506 | $ | 2.842 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | $ | 23.510 | € | 20.782 | 156 | 0 | 156 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 28.674 | $ | 32.170 | 0 | (484) | (484) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 1.744 | € | 1.547 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € | 10.062 | $ | 11.369 | 0 | (89) | (89) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.103.275 | € | 987.916 | 21.764 | 0 | 21.764 | 0,32 |
| | | | | | | $ 70.123 | $ (5.449) | $ 64.674 | 0,92 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional 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 | 07/2019 | £ | 153 | $ | 194 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.970 | £ | 1.561 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 51.423 | $ | 65.224 | 0 | (222) | (222) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.134 | £ | 895 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 64.110 | | 50.468 | 221 | 0 | 221 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | £ | 50.432 | $ | 64.080 | 1 | (106) | (105) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 62.476 | £ | 49.308 | 279 | 0 | 279 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 63.880 | | 50.199 | 107 | 0 | 107 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | £ | 944 | $ | 1.193 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 574 | | 727 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | $ | 284 | £ | 222 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 62.409 | | 49.308 | 346 | 0 | 346 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | | 62.070 | | 49.123 | 450 | 0 | 450 | 0,01 |
| | | | | | | $ 1.426 | $ (342) | $ 1.084 | 0,02 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | CNH | 16.914 | $ | 2.458 | $ 0 | $ (3) | $ (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4.203 | CNH | 29.127 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.466 | | 16.974 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CNH | 16.914 | $ | 2.458 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.466 | CNH | 16.974 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | CNH | 506 | $ | 73 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.335 | CNH | 9.245 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 1.335 | | 9.245 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | CNH | 16.914 | $ | 2.458 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.389 | CNH | 9.604 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.466 | | 16.974 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | CNH | 15.219 | $ | 2.212 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.335 | CNH | 9.245 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.219 | | 15.267 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | | | $ 85 | $ (12) | $ 73 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | SGD | 13.005 | $ | 9.603 | $ 0 | $ (9) | $ (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 9.294 | SGD | 12.825 | 185 | 0 | 185 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 9.636 | | 13.043 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 9.298 | | 12.769 | 141 | 0 | 141 | 0,00 |
| DUB | 07/2019 | | 9.292 | | 12.790 | 161 | 0 | 161 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | SGD | 12.983 | $ | 9.589 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 9.617 | SGD | 13.014 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SGD | 13.250 | $ | 9.762 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 9.569 | SGD | 12.977 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 9.496 | | 13.084 | 175 | 0 | 175 | 0,00 |
| RYL | 08/2019 | SGD | 192 | $ | 142 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SCX | 07/2019 | SGD 12.528 | $ 9.258 | $ 3 | $ (5) | $ (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 34 | SGD 46 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SGD 97 | $ 72 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 8.921 | SGD 12.061 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 182 | 250 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | $ 713 | $ (54) | $ 659 | 0,01 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 23.049** | **0,32** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **$ 7.728.500** | **112,69** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **$ (870.501)** | **(12,69)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **$ 6.857.999** | **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) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 968.294 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 13.905 und Barmittel in Höhe von USD 7.251 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 98.896 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 38.480 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(i) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 2,550 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 322.100 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 | $ (328.820) | $ 322.100 | $ 322.168 | 4,70 |
| FICC | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 85.298 | U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2021 | (87.007) | 85.298 | 85.312 | 1,24 |
| JPS | 2,800 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 500.000 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 | (511.430) | 500.000 | 500.117 | 7,29 |
| SCX | 2,900 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 300.000 | U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.11.2041 - 15.08.2044 | (307.374) | 300.000 | 300.073 | 4,38 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.234.631)** | **$ 1.207.398** | **$ 1.207.670** | **17,61** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 594.759 | $ 7.141.496 | $ 0 | $ 7.736.255 |
| Finanzderivate[3] | 4.471 | (12.226) | 0 | (7.755) |
| **Summen** | **$ 599.230** | **$ 7.129.270** | **$ 0** | **$ 7.728.500** |

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

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 7.574.716 | $ 0 | $ 7.574.716 |
| Finanzderivate[3] | 13.980 | (29.032) | 0 | (15.052) |
| **Summen** | **$ 13.980** | **$ 7.545.684** | **$ 0** | **$ 7.559.664** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 2,000 % | 16.04.2019 | 15.04.2021 | $ (1.734) | $ (1.742) | (0,03) |
| | 0,200 | 03.04.2019 | 02.04.2021 | £ (921) | (1.173) | (0,02) |
| CIW | 2,730 | 07.06.2019 | 05.07.2019 | $ (14.197) | (14.223) | (0,21) |
| | 2,730 | 14.06.2019 | 12.07.2019 | (4.461) | (4.467) | (0,06) |
| IND | 2,720 | 21.05.2019 | 20.08.2019 | (87.821) | (88.093) | (1,28) |
| JML | (1,000) | 16.05.2019 | 08.05.2021 | € (1.039) | (1.182) | (0,02) |
| RDR | 2,640 | 11.06.2019 | 11.07.2019 | $ (13.948) | (13.968) | (0,20) |
| | 2,650 | 18.06.2019 | 18.07.2019 | (90.037) | (90.123) | (1,31) |
| SCX | 2,720 | 21.05.2019 | 21.08.2019 | (177.490) | (178.040) | (2,60) |
| | 2,720 | 11.06.2019 | 21.08.2019 | (23.853) | (23.889) | (0,35) |
| UBS | 2,720 | 23.05.2019 | 23.08.2019 | (485.008) | (486.437) | (7,09) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (903.337)** | **(13,17)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 378 | $ (360) | $ 18 |
| BPS | (565) | 350 | (215) |
| BRC | 17.944 | (16.376) | 1.568 |
| CBK | (2.269) | (1.050) | (3.319) |
| DUB | 161 | (120) | 41 |
| GLM | 23.631 | (21.770) | 1.861 |
| GST | 180 | 0 | 180 |
| HUS | 447 | (380) | 67 |
| IND | 225 | 0 | 225 |
| JPM | (43) | (830) | (873) |
| MSB | 117 | 0 | 117 |
| MYI | (26) | 0 | (26) |
| RBC | (11) | 0 | (11) |
| RYL | 156 | 0 | 156 |
| SCX | 872 | (700) | 172 |
| SOG | 19 | 0 | 19 |
| SSB | 22.134 | (20.560) | 1.574 |
| TOR | (40.405) | 38.130 | (2.275) |
| UAG | 104 | 0 | 104 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 105,00 | 88,04 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 6,57 | 8,11 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 1,24 | 30,12 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,07 | 0,23 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,51) | (0,23) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,32 | (0,25) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (13,17) | (17,40) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Österreich | 0,86 | 1,71 |
| Belgien | 2,68 | 2,15 |
| Cayman-Inseln | 0,97 | 2,06 |
| Dänemark | 1,48 | 1,88 |
| Finnland | 0,68 | 0,00 |
| Frankreich | 8,71 | 8,00 |
| Deutschland | 0,51 | 0,68 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,99 | 1,04 |
| Irland | 8,66 | 1,29 |
| Italien | 5,87 | 6,00 |
| Japan | 0,00 | 0,03 |
| Jersey, Kanalinseln | 2,59 | 2,46 |
| Luxemburg | 0,89 | 0,64 |
| Niederlande | 9,04 | 10,14 |
| Portugal | 0,23 | 0,33 |
| Singapur | 0,24 | 0,27 |
| Spanien | 13,07 | 11,52 |
| Schweden | 0,00 | 0,13 |
| Schweiz | 5,35 | 4,87 |
| Großbritannien | 22,18 | 26,66 |
| Vereinigte Staaten | 9,12 | 12,86 |
| Kurzfristige Instrumente | 18,69 | 31,55 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,07 | 0,23 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | (0,09) | 0,02 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,03 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,46) | (0,25) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | 0,01 | 0,03 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | (0,25) |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,01 | (0,13) |
| Devisenterminkontrakte | (0,68) | (0,00) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,99 | 0,10 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (12,69) | (26,02) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Commodity Real Return Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | | |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | ARS | 3.337 | $ | 68 | 0,01 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 29.553 | | 680 | 0,13 |
| Summe Argentinien | | | | 748 | 0,14 |
| **AUSTRALIEN** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Driver Australia Four Trust** | | | | | |
| 2,185 % fällig am 21.08.2025 | AUD | 362 | | 254 | 0,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027 | | 3.663 | | 2.714 | 0,50 |
| 1,250 % fällig am 21.02.2022 | | 5.732 | | 4.178 | 0,78 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2025 | | 1.494 | | 1.253 | 0,23 |
| | | | | 8.145 | 1,51 |
| Summe Australien | | | | 8.399 | 1,56 |
| **BRASILIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | $ | 272 | | 292 | 0,05 |
| **KANADA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Enbridge, Inc.** | | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 1.000 | | 1.000 | 0,19 |
| 3,110 % fällig am 15.06.2020 | | 1.100 | | 1.103 | 0,20 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.03.2021 | | 800 | | 803 | 0,15 |
| | | | | 2.906 | 0,54 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.12.2050 (b) | CAD | 209 | | 169 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026 (b) | | 2.477 | | 2.481 | 0,46 |
| | | | | 2.650 | 0,49 |
| Summe Kanada | | | | 5.556 | 1,03 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Apidos CLO** | | | | | |
| 3,572 % fällig am 19.01.2025 | $ | 315 | | 315 | 0,06 |
| **Atrium Corp.** | | | | | |
| 3,422 % fällig am 22.04.2027 | | 500 | | 499 | 0,09 |
| **Benefit Street Partners CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,381 % fällig am 18.07.2027 | | 300 | | 299 | 0,06 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,432 % fällig am 27.01.2028 | | 1.140 | | 1.135 | 0,21 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | | | |
| 3,377 % fällig am 15.04.2027 | | 890 | | 890 | 0,16 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.10.2027 | | 900 | | 899 | 0,17 |
| **Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.** | | | | | |
| 3,512 % fällig am 20.04.2027 | | 400 | | 399 | 0,07 |
| **Jamestown CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,287 % fällig am 15.07.2026 | | 462 | | 461 | 0,09 |
| **Marathon CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,392 % fällig am 21.11.2027 | | 2.430 | | 2.420 | 0,45 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | | 500 | | 499 | 0,09 |
| 3,406 % fällig am 26.10.2027 | | 1.640 | | 1.637 | 0,30 |
| 3,438 % fällig am 17.04.2027 | | 300 | | 300 | 0,06 |
| **Palmer Square Loan Funding Ltd.** | | | | | |
| 3,247 % fällig am 15.07.2026 | | 2.213 | | 2.200 | 0,41 |
| **TICP CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,601 % fällig am 20.04.2028 | | 1.570 | | 1.557 | 0,29 |
| **Tralee CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,622 % fällig am 20.10.2027 | $ | 600 | $ | 600 | 0,11 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,417 % fällig am 15.04.2027 | | 1.440 | | 1.438 | 0,27 |
| 3,477 % fällig am 15.07.2027 | | 500 | | 501 | 0,09 |
| 3,742 % fällig am 22.10.2031 | | 2.300 | | 2.299 | 0,43 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,300 % fällig am 25.07.2026 | | 595 | | 595 | 0,11 |
| **Z Capital Credit Partners CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,551 % fällig am 16.07.2027 | | 850 | | 848 | 0,16 |
| | | | | 19.791 | 3,68 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **MDC-GMTN BV** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.11.2020 | | 600 | | 620 | 0,12 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2021 | | 100 | | 101 | 0,02 |
| | | | | 721 | 0,14 |
| Summe Cayman Inseln | | | | 20.512 | 3,82 |
| **DÄNEMARK** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 35.600 | | 5.360 | 1,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 7 | | 1 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 15.100 | | 2.274 | 0,42 |
| 2,000 % fällig am 01.04.2020 | | 22.100 | | 3.446 | 0,64 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 20 | | 3 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 41.700 | | 6.280 | 1,17 |
| 2,000 % fällig am 01.04.2020 | | 39.300 | | 6.114 | 1,14 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 96 | | 15 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | | 102 | | 17 | 0,00 |
| | | | | 23.510 | 4,37 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Denmark Government International Bond** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (b) | | 11.820 | | 1.943 | 0,36 |
| Summe Dänemark | | | | 25.453 | 4,73 |
| **FRANKREICH** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 25.07.2021 (b) | € | 6.674 | | 7.828 | 1,46 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 (b) | | 3.251 | | 3.955 | 0,74 |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (b) | | 957 | | 1.176 | 0,22 |
| 1,100 % fällig am 25.07.2022 (b) | | 8.462 | | 10.397 | 1,93 |
| 1,300 % fällig am 25.07.2019 (b) | | 2.157 | | 2.461 | 0,46 |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 (b) | | 240 | | 415 | 0,08 |
| 2,100 % fällig am 25.07.2023 (b) | | 11.511 | | 14.961 | 2,78 |
| 2,250 % fällig am 25.07.2020 (b) | | 16.539 | | 19.533 | 3,63 |
| Summe Frankreich | | | | 60.726 | 11,30 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | $ | 1.700 | | 1.724 | 0,32 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 400 | | 415 | 0,08 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 95 | | 99 | 0,02 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | | 514 | 0,10 |
| **INDIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **State Bank of India** | | | | | |
| 3,539 % fällig am 06.04.2020 | | 500 | | 501 | 0,09 |
| **IRLAND** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Aurium CLO DAC** | | | | | |
| 0,800 % fällig am 26.04.2029 | € | 400 | $ | 456 | 0,09 |
| **Black Diamond CLO Designated Activity Co.** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | | 380 | | 433 | 0,08 |
| 3,646 % fällig am 03.10.2029 | $ | 250 | | 251 | 0,05 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,730 % fällig am 21.09.2029 | € | 200 | | 228 | 0,04 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | | 100 | | 114 | 0,02 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 1.700 | | 1.936 | 0,36 |
| **Tymon Park CLO Ltd.** | | | | | |
| 0,590 % fällig am 21.01.2029 | | 200 | | 227 | 0,04 |
| | | | | 3.645 | 0,68 |
| | | **ANZAHL** | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (d)** | | 237.000 | | 24.053 | 4,48 |
| Summe Irland | | | | 27.698 | 5,16 |
| | | **PARI (000S)** | | | |
| **ITALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Wind Tre SpA** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 20.01.2023 | € | 600 | | 690 | 0,13 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | | |
| 0,450 % fällig am 22.05.2023 (b) | | 3.505 | | 3.914 | 0,73 |
| 1,300 % fällig am 15.05.2028 (b) | | 188 | | 215 | 0,04 |
| 1,650 % fällig am 23.04.2020 (b) | | 401 | | 463 | 0,09 |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 (b) | | 7.707 | | 9.196 | 1,71 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (b) | | 11.303 | | 13.878 | 2,58 |
| 2,600 % fällig am 15.09.2023 (b) | | 10.153 | | 12.542 | 2,33 |
| | | | | 40.208 | 7,48 |
| Summe Italien | | | | 40.898 | 7,61 |
| **JAPAN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | | |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | $ | 1.700 | | 1.703 | 0,32 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Japan Government International Bond** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (b) | ¥ | 691.802 | | 6.707 | 1,24 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2029 (b) | | 165.488 | | 1.604 | 0,30 |
| | | | | 8.311 | 1,54 |
| Summe Japan | | | | 10.014 | 1,86 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Cairn CLO BV** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | € | 200 | | 229 | 0,04 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | | 2.650 | | 3.010 | 0,56 |
| | | | | 3.239 | 0,60 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (c)(e) | | 200 | | 237 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (c)(e) | | 400 | | 505 | 0,09 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | | |
| 1,950 % fällig am 19.09.2021 | $ | 2.100 | | 2.079 | 0,39 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 3,933 % fällig am 23.04.2021 | | 1.000 | | 1.019 | 0,19 |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | | 400 | | 416 | 0,08 |
| | | | | 4.256 | 0,79 |
| Summe Niederlande | | | | 7.495 | 1,39 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | NZD | 2.663 | $ 1.955 | 0,36 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 2.200 | 730 | 0,14 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 3.700 | 1.238 | 0,23 |
| Summe Peru | | | 1.968 | 0,37 |
| **KATAR** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 600 | 630 | 0,12 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 500 | 597 | 0,11 |
| 5,250 % fällig am 20.01.2020 | | 300 | 305 | 0,06 |
| Summe Katar | | | 1.532 | 0,29 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 310 | 330 | 0,06 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (c)(e) | € | 400 | 472 | 0,09 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | | 200 | 246 | 0,05 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 500 | 586 | 0,11 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 0,650 % fällig am 30.11.2027 (b) | | 8.113 | 10.288 | 1,91 |
| | | | 11.120 | 2,07 |
| Summe Spanien | | | 11.592 | 2,16 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sweden Government International Bond** | | | | |
| 0,125 % fällig am 01.06.2026 | SEK | 2.555 | 321 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2020 | | 20.034 | 2.360 | 0,44 |
| Summe Schweden | | | 2.681 | 0,50 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 4,377 % fällig am 14.04.2021 | $ | 4.000 | 4.098 | 0,76 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.07.2020 | | 700 | 702 | 0,13 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,186 % fällig am 21.06.2021 | | 800 | 800 | 0,15 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | | 600 | 599 | 0,11 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 400 | 417 | 0,08 |
| | | | 2.518 | 0,47 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,911 % fällig am 18.03.2039 | £ | 28 | 35 | 0,01 |
| 0,931 % fällig am 18.06.2038 | | 35 | 44 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 2.400 | 3.066 | 0,56 |
| | | | 3.145 | 0,58 |

| BESCHREIBUNG | ANZAHL | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | |
| 10,250 % | 7.021 | $ 1.353 | 0,25 |

| | | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.11.2019 (b) | £ | 1.269 | 1.630 | 0,30 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2026 (b) | | 10.376 | 15.762 | 2,93 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2028 (b) | | 3.456 | 5.559 | 1,04 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 (b) | | 4.498 | 7.743 | 1,44 |
| 1,875 % fällig am 22.11.2022 (b) | | 17.160 | 25.426 | 4,73 |
| 2,500 % fällig am 16.04.2020 | | 481 | 635 | 0,12 |
| | | | 56.755 | 10,56 |
| Summe Großbritannien | | | 63.771 | 11,86 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,444 % fällig am 25.05.2034 | $ | 97 | 94 | 0,02 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.10.2034 | | 456 | 461 | 0,09 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,780 % fällig am 25.10.2037 | | 670 | 679 | 0,13 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,549 % fällig am 25.09.2036 | | 1.098 | 1.068 | 0,20 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,349 % fällig am 25.10.2034 | | 600 | 601 | 0,11 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,864 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 800 | 762 | 0,14 |
| **CoreVest American Finance Trust** | | | | |
| 2,968 % fällig am 15.10.2049 | | 151 | 152 | 0,03 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,934 % fällig am 25.02.2036 | | 1.000 | 1.001 | 0,19 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.05.2035 | | 1.995 | 2.017 | 0,37 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,714 % fällig am 25.07.2036 | | 100 | 96 | 0,02 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 3,259 % fällig am 25.08.2034 | | 244 | 244 | 0,04 |
| **LMREC, Inc.** | | | | |
| 3,408 % fällig am 22.02.2032 | | 647 | 646 | 0,12 |
| **Mid-State Capital Corp. Trust** | | | | |
| 5,787 % fällig am 15.10.2040 | | 150 | 167 | 0,03 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 3,064 % fällig am 25.01.2035 | | 401 | 399 | 0,07 |
| 3,379 % fällig am 25.07.2034 | | 228 | 226 | 0,04 |
| **Navient Student Loan Trust** | | | | |
| 3,554 % fällig am 25.03.2066 | | 491 | 494 | 0,09 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.11.2034 | | 213 | 201 | 0,04 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,994 % fällig am 25.08.2035 | | 300 | 301 | 0,06 |
| **RMAT LP** | | | | |
| 4,090 % fällig am 25.05.2048 | | 1.001 | 1.010 | 0,19 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,694 % fällig am 25.09.2036 | | 3.000 | 2.834 | 0,53 |
| 2,714 % fällig am 25.09.2047 | | 559 | 546 | 0,10 |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | | |
| 1,850 % fällig am 17.06.2030 | | 62 | 62 | 0,01 |
| 4,644 % fällig am 16.06.2042 | | 280 | 283 | 0,05 |
| **SoFi Professional Loan Program LLC** | | | | |
| 2,050 % fällig am 25.01.2041 | | 401 | 400 | 0,07 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | | 474 | 476 | 0,09 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,064 % fällig am 25.10.2035 | | 27 | 27 | 0,01 |
| | | | 15.247 | 2,84 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 200 | 202 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | $ | 800 | $ 804 | 0,15 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 700 | 706 | 0,13 |
| 5,150 % fällig am 15.02.2050 | | 400 | 442 | 0,08 |
| 5,300 % fällig am 15.08.2058 | | 100 | 111 | 0,02 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.10.2020 | | 3.100 | 3.280 | 0,61 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 2,297 % fällig am 14.08.2020 | | 400 | 399 | 0,07 |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | | 700 | 702 | 0,13 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 1.000 | 1.051 | 0,20 |
| **Citicorp Lease Pass-Through Trust** | | | | |
| 8,040 % fällig am 15.12.2019 | | 223 | 229 | 0,04 |
| **Consolidated Edison Co. of New York, Inc.** | | | | |
| 2,749 % fällig am 25.06.2021 | | 200 | 201 | 0,04 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 3,173 % fällig am 09.03.2021 | | 500 | 502 | 0,09 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 04.12.2020 | | 1.900 | 1.899 | 0,35 |
| 3,625 % fällig am 15.03.2022 | | 1.300 | 1.323 | 0,25 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 100 | 101 | 0,02 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | | 800 | 804 | 0,15 |
| **Duke Energy Corp.** | | | | |
| 3,028 % fällig am 14.05.2021 | | 1.700 | 1.705 | 0,32 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 600 | 597 | 0,11 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,459 % fällig am 27.03.2020 | | 400 | 399 | 0,07 |
| 2,681 % fällig am 09.01.2020 | | 800 | 800 | 0,15 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,610 % fällig am 15.09.2020 | | 1.400 | 1.414 | 0,26 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 100 | 108 | 0,02 |
| **John Deere Capital Corp.** | | | | |
| 2,633 % fällig am 22.06.2020 | | 1.500 | 1.503 | 0,28 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 08.05.2018 ^ | £ | 100 | 3 | 0,00 |
| **McDonald's Corp.** | | | | |
| 3,012 % fällig am 28.10.2021 | $ | 1.400 | 1.401 | 0,26 |
| **Mississippi Power Co.** | | | | |
| 2,961 % fällig am 27.03.2020 | | 2.300 | 2.301 | 0,43 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 30.06.2021 | | 100 | 100 | 0,02 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 25.03.2021 | | 300 | 313 | 0,06 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | | 980 | 980 | 0,18 |
| 2,921 % fällig am 21.08.2020 | | 1.100 | 1.100 | 0,21 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 11.07.2022 | | 400 | 425 | 0,08 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 100 | 104 | 0,02 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 200 | 199 | 0,04 |
| **Southern Power Co.** | | | | |
| 2,937 % fällig am 20.12.2020 | | 500 | 500 | 0,09 |
| **Spectra Energy Partners LP** | | | | |
| 3,179 % fällig am 05.06.2020 | | 100 | 100 | 0,02 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.09.2021 | | 1.200 | 1.232 | 0,23 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 2,450 % fällig am 20.11.2019 | | 700 | 700 | 0,13 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 29.04.2022 | | 600 | 612 | 0,11 |
| | | | 29.352 | 5,46 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010** | | | | |
| 7,734 % fällig am 15.02.2033 | | 200 | 289 | 0,05 |
| **Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 6,918 % fällig am 01.04.2040 | | 600 | 866 | 0,16 |

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

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009** | | | |
| 7,300 % fällig am 01.10.2039 | $ 500 | $ 752 | 0,14 |
| 7,500 % fällig am 01.04.2034 | 100 | 151 | 0,03 |
| 7,550 % fällig am 01.04.2039 | 200 | 317 | 0,06 |
| **Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 5,516 % fällig am 01.07.2027 | 500 | 607 | 0,11 |
| **New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 5,508 % fällig am 01.08.2037 | 200 | 256 | 0,05 |
| **New York State Urban Development Corp., Revenue Bonds, (BABs), Series 2009** | | | |
| 5,770 % fällig am 15.03.2039 | 100 | 122 | 0,02 |
| | | 3.360 | 0,62 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | |
| 4,044 % fällig am 25.09.2045 | 46 | 47 | 0,01 |
| 4,213 % fällig am 25.10.2034 | 2 | 2 | 0,00 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 4,746 % fällig am 20.09.2034 | 27 | 28 | 0,01 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 5,250 % fällig am 26.04.2037 | 440 | 372 | 0,07 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 4,013 % fällig am 25.09.2034 | 115 | 116 | 0,02 |
| 4,351 % fällig am 25.01.2035 | 57 | 57 | 0,01 |
| 4,392 % fällig am 25.05.2047 ^ | 14 | 13 | 0,00 |
| 4,673 % fällig am 25.02.2034 | 18 | 19 | 0,00 |
| 4,713 % fällig am 25.11.2034 | 12 | 13 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 4,016 % fällig am 25.08.2036 ^ | 18 | 12 | 0,00 |
| 4,544 % fällig am 25.10.2033 | 14 | 15 | 0,00 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | |
| 4,239 % fällig am 25.03.2037 ^ | 11 | 11 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,630 % fällig am 25.06.2047 | 442 | 445 | 0,08 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 4,200 % fällig am 25.09.2035 | 5 | 5 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2034 | 758 | 772 | 0,15 |
| **Civic Mortgage LLC** | | | |
| 4,349 % fällig am 25.11.2022 | 1.216 | 1.216 | 0,23 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,593 % fällig am 20.07.2046 ^ | 16 | 13 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 ^ | 19 | 18 | 0,00 |
| 4,419 % fällig am 25.02.2037 ^ | 14 | 13 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | 121 | 124 | 0,02 |
| 3,164 % fällig am 25.09.2034 | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,025 % fällig am 25.09.2047 ^ | 12 | 12 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,844 % fällig am 25.06.2045 | 148 | 141 | 0,03 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,086 % fällig am 25.06.2034 | 16 | 16 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 25.09.2035 | 5 | 5 | 0,00 |
| 4,664 % fällig am 25.07.2035 | 135 | 138 | 0,03 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,983 % fällig am 20.06.2035 | 401 | 400 | 0,08 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 2,734 % fällig am 25.10.2035 | 49 | 50 | 0,01 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 3,304 % fällig am 25.10.2033 | 8 | 8 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,044 % fällig am 25.07.2045 | 5 | 5 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 4,635 % fällig am 25.08.2035 | $ 19 | $ 19 | 0,00 |
| 4,674 % fällig am 25.04.2035 | 82 | 84 | 0,02 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,834 % fällig am 15.12.2030 | 2 | 2 | 0,00 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,500 % fällig am 25.05.2058 | 1.036 | 1.099 | 0,21 |
| **Regal Trust** | | | |
| 2,666 % fällig am 29.09.2031 | 11 | 11 | 0,00 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032 | 10 | 10 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,583 % fällig am 20.07.2036 | 1.458 | 1.421 | 0,27 |
| 3,090 % fällig am 19.10.2026 | 8 | 8 | 0,00 |
| 4,807 % fällig am 20.04.2035 | 60 | 64 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 2,970 % fällig am 19.07.2034 | 4 | 4 | 0,00 |
| 3,050 % fällig am 19.10.2034 | 21 | 21 | 0,01 |
| 3,090 % fällig am 19.03.2034 | 16 | 16 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 4,617 % fällig am 25.07.2032 | 1 | 1 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,714 % fällig am 25.01.2045 | 34 | 34 | 0,01 |
| 2,774 % fällig am 25.01.2045 | 181 | 180 | 0,03 |
| 3,184 % fällig am 25.10.2044 | 380 | 379 | 0,07 |
| 3,904 % fällig am 25.06.2042 | 2 | 2 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,959 % fällig am 25.12.2034 | 6 | 6 | 0,00 |
| 4,973 % fällig am 25.12.2034 | 79 | 82 | 0,02 |
| 5,146 % fällig am 25.03.2035 | 57 | 59 | 0,01 |
| | | 7.590 | 1,41 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 2,804 % fällig am 25.03.2049 | 2.844 | 2.838 | 0,53 |
| 2,974 % fällig am 25.09.2036 | 5 | 5 | 0,00 |
| 5,155 % fällig am 01.11.2034 | 376 | 376 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2044 | 7 | 8 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.06.2028 | 15 | 17 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 49.380 | 50.467 | 9,39 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 50.100 | 51.768 | 9,63 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 2,710 % fällig am 25.09.2031 | 18 | 18 | 0,00 |
| 2,844 % fällig am 15.12.2031 | 2 | 2 | 0,00 |
| 2,894 % fällig am 15.04.2028 | 11 | 11 | 0,00 |
| 3,040 % fällig am 15.03.2024 | 7 | 7 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 15.03.2032 | 125 | 126 | 0,02 |
| 4,765 % fällig am 01.01.2034 | 4 | 4 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2035 | 574 | 631 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2036 | 6 | 7 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 2,633 % fällig am 20.02.2035 | 56 | 55 | 0,01 |
| 2,740 % fällig am 20.10.2043 | 1.335 | 1.330 | 0,25 |
| 2,783 % fällig am 20.02.2049 | 2.861 | 2.859 | 0,53 |
| 2,975 % fällig am 20.02.2038 | 31 | 31 | 0,01 |
| 2,978 % fällig am 20.03.2060 | 47 | 47 | 0,01 |
| 3,030 % fällig am 20.08.2068 | 1.105 | 1.084 | 0,20 |
| 3,259 % fällig am 20.07.2062 | 1.192 | 1.204 | 0,23 |
| 3,352 % fällig am 20.08.2062 | 1.647 | 1.649 | 0,31 |
| | | 114.544 | 21,31 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (f) | 45.727 | 45.254 | 8,42 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2021 (f) | $ 102.682 | $ 101.750 | 18,93 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2022 | 519 | 516 | 0,09 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 (f) | 32.873 | 32.621 | 6,07 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2023 | 4.473 | 4.449 | 0,83 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 | 7.152 | 7.106 | 1,32 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | 7.662 | 7.674 | 1,43 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 7.385 | 7.469 | 1,39 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | 9.541 | 9.610 | 1,79 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | 11.897 | 12.012 | 2,23 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 (f) | 18.297 | 18.602 | 3,46 |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 | 4.308 | 4.336 | 0,81 |
| 0,625 % fällig am 15.04.2023 | 2.191 | 2.217 | 0,41 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 (f) | 15.753 | 16.138 | 3,00 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | 5.741 | 5.984 | 1,11 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | 2.062 | 2.042 | 0,38 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | 7.313 | 7.701 | 1,43 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | 194 | 204 | 0,04 |
| 1,125 % fällig am 15.01.2021 | 6.331 | 6.381 | 1,19 |
| 1,250 % fällig am 15.07.2020 | 4.052 | 4.079 | 0,76 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | 965 | 1.096 | 0,20 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | 8.596 | 9.641 | 1,79 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 1.371 | 1.526 | 0,28 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 | 165 | 212 | 0,04 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | 1.867 | 2.407 | 0,45 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (f) | 14.504 | 16.212 | 3,01 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | 3.248 | 3.908 | 0,73 |
| 3,375 % fällig am 15.04.2032 | 930 | 1.275 | 0,24 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | 1.368 | 1.832 | 0,34 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,750 % fällig am 15.02.2024 (f) | 13.900 | 14.517 | 2,70 |
| | | 348.771 | 64,87 |
| Summe USA | | 518.864 | 96,51 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| **Broadcom, Inc.** | | | |
| 2,830 % fällig am 18.07.2019 | 250 | 250 | 0,05 |
| 2,870 % fällig am 16.07.2019 | 300 | 299 | 0,05 |
| **Campbell Soup Co.** | | | |
| 2,980 % fällig am 15.07.2019 | 250 | 250 | 0,05 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | |
| 2,800 % fällig am 17.07.2019 | 400 | 399 | 0,07 |
| **Encana Corp.** | | | |
| 3,120 % fällig am 08.07.2019 | 400 | 400 | 0,07 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | |
| 3,040 % fällig am 08.07.2019 | 700 | 699 | 0,14 |
| **Royal Caribbean Cruises** | | | |
| 2,900 % fällig am 15.07.2019 | 250 | 250 | 0,05 |
| **VW Credit, Inc.** | | | |
| 2,900 % fällig am 09.07.2019 | 500 | 500 | 0,09 |
| | | 3.047 | 0,57 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (g)** | | | |
| | | 6.933 | 1,29 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 9.980 | 1,86 |
| | **ANZAHL** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | 1.760 | 18 | 0,00 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | $ 827.319 | 153,89 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 69 | $ (8) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 11 | (13) | 0,00 |

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 113,800 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 452 | $ 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 134,500 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 77 | (2) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 153,000 EUR auf Euro-BTP 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 98 | 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 56 | (140) | (0,03) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 33 | (67) | (0,01) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 178,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 178 | 0 | 0,00 |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09/2019 | 100 | 60 | 0,01 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2019 | 91 | (554) | (0,10) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 334 | 670 | 0,12 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 61 | (199) | (0,04) |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 186 | (712) | (0,13) |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09/2019 | 686 | (105) | (0,02) |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 3 | 1 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 112,100 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 235 | 12 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 129,750 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 436 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 154,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 264 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 56 | 63 | 0,01 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 33 | 33 | 0,01 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 1 | (2) | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 152 | 301 | 0,05 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 202 | (648) | (0,12) |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 172 | (972) | (0,18) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 26 | 175 | 0,03 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09/2019 | 46 | (19) | 0,00 |
| | | | | $ (2.126) | (0,40) |

[1] Future-Style-Option.

**GEKAUFTE OPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | $ 112,000 | 23.08.2019 | 24 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 145,500 | 23.08.2019 | 221 | 2 | 1 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 109,750 | 23.08.2019 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 193,000 | 23.08.2019 | 159 | 2 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 108,000 | 23.08.2019 | 130 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 5 | $ 1 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 129,000 | 26.07.2019 | 28 | $ (7) | $ (7) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (2.132)** | **(0,40)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Daimler AG | 1,000 % | 20.12.2020 | € 190 | $ 0 | 0,00 |
| Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2019 | 100 | 0 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2020 | $ 100 | 4 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | 14 | 0,00 |
| | | | | $ 18 | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-31 5-Year Index | (5,000) % | 20.12.2023 | $ 6.402 | $ (176) | (0,03) |
| CDX.HY-32 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2024 | 2.600 | (2) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 26 5-Year Index | (1,000) | 20.12.2021 | € 2.200 | (17) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 28 5-Year Index | (1,000) | 20.12.2022 | 6.300 | 2 | 0,00 |
| | | | | $ (193) | (0,03) |

## 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 | 2,000 % | 15.12.2047 | $ 1.750 | $ (12) | 0,00 |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,428 | 20.12.2047 | 400 | (42) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,478 | 20.12.2047 | 1.115 | (131) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,499 | 20.12.2047 | 570 | (69) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month NZD-BBR | 3,250 | 21.03.2028 | NZD 900 | (85) | (0,02) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,850 | 20.07.2026 | $ 1.900 | (56) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,850 | 27.07.2026 | 2.100 | (61) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,950 | 08.11.2026 | 15.000 | (470) | (0,09) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 20.06.2023 | 18.700 | 909 | 0,17 |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 27.07.2026 | 13.600 | (450) | (0,08) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,150 | 19.06.2048 | 20 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 16.12.2022 | 12.530 | 9 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.12.2022 | 29.700 | 475 | 0,09 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 5.460 | (460) | (0,09) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 27.04.2026 | 1.200 | (36) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,400 | 07.12.2026 | 300 | (10) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 19.12.2023 | 200 | 3 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 16.12.2035 | 900 | (42) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 4.350 | (776) | (0,15) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,677 | 25.10.2023 | 4.000 | 157 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2023 | 1.000 | 50 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 2.048 | (328) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,969 | 25.10.2048 | 300 | (49) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 2.900 | (669) | (0,13) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 3,100 | 17.04.2028 | 13.750 | (596) | (0,11) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 3,134 | 13.09.2028 | 13.100 | (594) | (0,11) |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | £ 2.150 | (221) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 20.09.2027 | ¥ 74.880 | (19) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,066 | 15.02.2024 | € 3.800 | 36 | 0,01 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,167 | 15.03.2024 | 3.300 | 32 | 0,01 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,232 | 15.12.2023 | 6.500 | (144) | (0,03) |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,323 | 15.03.2029 | 310 | 9 | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,475 | 15.05.2023 | 1.900 | 47 | 0,01 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,535 | 15.06.2023 | 2.900 | 88 | 0,02 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,535 | 15.03.2028 | 520 | 29 | 0,01 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,570 | 15.03.2039 | 350 | 28 | 0,01 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,710 | 15.03.2033 | 400 | (41) | (0,01) |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,946 | 15.03.2048 | 260 | 66 | 0,01 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,816 | 13.05.2021 | $ 17.100 | (22) | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,954 | 03.06.2029 | 700 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,550 | 26.07.2021 | 1.100 | (15) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,603 | 12.09.2021 | 770 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,678 | 24.05.2021 | 4.400 | 7 | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,721 | 15.07.2020 | 1.900 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,730 | 26.07.2026 | 1.100 | 36 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,762 | 30.08.2026 | 2.300 | 77 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,801 | 12.09.2026 | 770 | 26 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,845 | 24.05.2026 | 1.100 | 12 | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,875 | 14.03.2021 | 4.100 | (7) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,927 | 18.03.2021 | 2.100 | (6) | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,080 | 25.07.2027 | 1.600 | 24 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,122 | 01.08.2027 | 2.100 | 40 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,150 | 25.09.2027 | 800 | 16 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,155 | 17.10.2027 | 1.900 | 40 | 0,01 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,168 | 15.07.2020 | 2.600 | (15) | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,180 | 20.09.2027 | 840 | 20 | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,210 | 05.02.2023 | 5.270 | (104) | (0,02) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,263 | 27.04.2023 | 1.450 | (37) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,263 | 09.05.2023 | 1.790 | (46) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,281 | 10.05.2023 | 2.750 | (78) | (0,02) |
| Erhalt | CPURNSA | 2,335 | 05.02.2028 | 2.680 | 116 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,353 | 09.05.2028 | 1.790 | 89 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,360 | 09.05.2028 | 2.690 | 136 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,364 | 10.05.2028 | 2.750 | 140 | 0,03 |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,030 | 15.03.2024 | € 3.300 | (30) | (0,01) |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,345 | 15.06.2021 | 3.700 | (56) | (0,01) |
| Erhalt | FRCPXTOB | 1,590 | 15.02.2028 | 260 | 19 | 0,00 |
| Erhalt | FRCPXTOB | 1,910 | 15.01.2038 | 890 | 153 | 0,03 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | UKRPI | 3,580 % | 15.06.2039 | £ 130 | $ 0 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,590 | 15.06.2039 | 110 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,600 | 15.06.2039 | 1.640 | 12 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,100 | 15.06.2031 | 2.300 | (6) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,358 | 15.04.2035 | 300 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,400 | 15.06.2030 | 1.610 | (20) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,470 | 15.09.2032 | 1.130 | (16) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,500 | 15.09.2033 | 680 | (12) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,530 | 15.10.2031 | 540 | (17) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,579 | 15.10.2033 | 640 | 8 | 0,00 |
| | | | | | $ (2.952) | (0,55) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (3.127)** | **(0,58)** |

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

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Kauf | 1,950 % | 18.09.2019 | 7.100 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 1.500 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.200 | (1) | 0 | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 1.300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.900 | (3) | (1) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 3.000 | (7) | (1) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 1.200 | (1) | 0 | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 1.100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.100 | (2) | 0 | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.300 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 1.400 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 2.200 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 1.700 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.300 | (2) | (1) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (32) | $ (5) | 0,00 |

**INFLATION-CAPPED OPTIONS**

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Cap - OTC CPALEMU | $ 100,151 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035 | 1.200 | $ (55) | $ (2) | 0,00 |
| JPM | Floor - OTC YOY CPURNSA | 234,812 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 24.03.2020 | 3.700 | (42) | 0 | 0,00 |
| | Floor - OTC YOY CPURNSA | 238,654 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 02.10.2020 | 2.000 | (37) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (134) | $ (3) | 0,00 |

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

## ZINSCAPS

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2] | 10-Year USD-ISDA - 2-Year USD-ISDA | 0,000 % | 02.01.2020 | 28.600 | $ (22) | $ (3) | 0,00 |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

[2] Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Mexico Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 300 | $ 2 | $ (2) | $ 0 | 0,00 |
| BPS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 2.100 | 21 | (22) | (1) | 0,00 |
| BRC | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 200 | 2 | (2) | 0 | 0,00 |
| GST | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 1.800 | 16 | (16) | 0 | 0,00 |
| HUS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 1.100 | 10 | (10) | 0 | 0,00 |
| JPM | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 400 | 3 | (3) | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 54 | $ (55) | $ (1) | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | $ 1.500 | $ (104) | $ 121 | $ 17 | 0,00 |
| 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) | 0 | (1) | 0,00 |
| | | | | | $ (199) | $ 237 | $ 38 | 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.

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 % | 20.06.2028 | ILS 890 | $ 0 | $ 14 | $ 14 | 0,00 |
| BRC | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,374) | 20.06.2020 | 3.790 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,950 | 20.06.2028 | 810 | 0 | 11 | 11 | 0,00 |
| DUB | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 2,100 | 20.06.2028 | 750 | 0 | 13 | 13 | 0,00 |
| GLM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | 2.850 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,290) | 16.02.2020 | 6.800 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,270) | 21.03.2020 | 4.250 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,971 | 16.02.2028 | 1.430 | 0 | 24 | 24 | 0,01 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 610 | 0 | 9 | 9 | 0,00 |
| HUS | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | 2.230 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 480 | 0 | 7 | 7 | 0,00 |
| JPM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,420) | 20.06.2020 | 3.510 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYC | Erhalt | CPURNSA | (1,805) | 20.09.2026 | $ 300 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Erhalt | CPURNSA | (1,800) | 20.07.2026 | 400 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | | | | | | $ 0 | $ 63 | $ 63 | 0,01 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Erhalt | BCOMTR Index | 350.725 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 57.437 | 14.02.2020 | $ 0 | $ 1.369 | $ 1.369 | 0,25 |
| CBK | Erhalt | BCOMTR Index | 473.795 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 77.591 | 14.02.2020 | 0 | 1.850 | 1.850 | 0,34 |
| | Erhalt | CIXBSTR3 Index | 548.678 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 97.099 | 14.02.2020 | 0 | 2.308 | 2.308 | 0,43 |
| CIB | Erhalt | BCOMTR Index | 154.350 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 25.277 | 14.02.2020 | 0 | 603 | 603 | 0,11 |
| FBF | Erhalt | BCOMTR Index | 77.214 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 12.645 | 14.02.2020 | 0 | 302 | 302 | 0,06 |

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Erhalt | BCOMF1T Index | 75.522 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 24.447 | 14.02.2020 | $ 0 | $ 588 | $ 588 | 0,11 |
| | Erhalt | BCOMTR Index | 323.155 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 52.921 | 14.02.2020 | 0 | 1.262 | 1.262 | 0,24 |
| | Erhalt | BCOMTR2 Index | 68.384 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 11.233 | 14.02.2020 | 0 | 267 | 267 | 0,05 |
| JPM | Erhalt | BCOMF1T Index | 276.501 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 89.506 | 14.02.2020 | 0 | 2.153 | 2.153 | 0,40 |
| | Erhalt | BCOMTR Index | 276.801 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 45.330 | 14.02.2020 | 0 | 1.081 | 1.081 | 0,20 |
| | Erhalt | JMABDEWE Index | 494.170 | 0,053 | 74.528 | 14.02.2020 | 0 | 531 | 531 | 0,10 |
| MEI | Erhalt | BCOMTR Index | 142.977 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 23.415 | 14.02.2020 | 0 | 558 | 558 | 0,10 |
| SOG | Erhalt | BCOMTR Index | 17.598 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.882 | 14.02.2020 | 0 | 69 | 69 | 0,01 |
| | | | | | | | $ 0 | $ 12.941 | $ 12.941 | 2,40 |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 112.602 | $ | 125.818 | $ 0 | $ (2.413) | $ (2.413) | (0,45) |
| | 07/2019 | $ | 8.358 | AUD | 11.968 | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| | 08/2019 | AUD | 11.968 | $ | 8.367 | 0 | (41) | (41) | (0,01) |
| | 10/2019 | DKK | 24.172 | | 3.710 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | AUD | 61 | | 42 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 321 | | 360 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 2.160 | | 2.754 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 115.500 | | 1.080 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 2.920 | | 1.917 | 0 | (44) | (44) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 1.479 | € | 1.311 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 61.657 | £ | 48.612 | 211 | 0 | 211 | 0,04 |
| | 08/2019 | £ | 48.612 | $ | 61.752 | 0 | (213) | (213) | (0,04) |
| | 08/2019 | ¥ | 85.900 | | 799 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 39 | ARS | 1.748 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 687 | MXN | 13.694 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 3.341.710 | $ | 2.819 | 0 | (74) | (74) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 2.700 | COP | 9.120.797 | 129 | 0 | 129 | 0,02 |
| | 10/2019 | DKK | 35.410 | $ | 5.444 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 13.694 | | 680 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | £ | 119 | | 151 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 13.056 | | 657 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 11.907 | | 8.243 | 0 | (113) | (113) | (0,02) |
| | 07/2019 | CAD | 3.465 | | 2.569 | 0 | (83) | (83) | (0,02) |
| | 07/2019 | £ | 429 | | 543 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 705.100 | | 6.489 | 6 | (61) | (55) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 2.284 | DKK | 15.015 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 123.137 | € | 108.348 | 249 | 0 | 249 | 0,05 |
| | 08/2019 | € | 108.348 | $ | 123.451 | 0 | (250) | (250) | (0,05) |
| | 08/2019 | PEN | 2.580 | | 767 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.492 | RUB | 163.952 | 91 | 0 | 91 | 0,02 |
| | 10/2019 | DKK | 30.030 | $ | 4.605 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 4.124 | | 1.221 | 0 | (28) | (28) | (0,01) |
| | 04/2020 | DKK | 50.080 | | 7.845 | 35 | 0 | 35 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | £ | 2.704 | | 3.442 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.775 | € | 2.450 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 2.734 | IDR | 40.119.615 | 79 | 0 | 79 | 0,02 |
| | 10/2019 | | 701 | MXN | 13.694 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | € | 40 | $ | 45 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 42 | | 28 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 338 | € | 297 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 211 | RUB | 13.988 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 1.993 | $ | 1.458 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 52.931 | | 1.691 | 0 | (29) | (29) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | DKK | 11.176 | | 1.697 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 320 | | 361 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 2.640 | | 3.340 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 940 | € | 837 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.445 | ZAR | 21.050 | 46 | 0 | 46 | 0,01 |
| | 09/2019 | INR | 8.407 | $ | 119 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 17.006 | | 542 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 40.560 | | 51.337 | 0 | (284) | (284) | (0,05) |
| | 07/2019 | SEK | 25.905 | | 2.707 | 0 | (85) | (85) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 251 | RUB | 16.669 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.793 | SEK | 25.905 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 25.905 | $ | 2.800 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 21.221 | | 678 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | DKK | 1.457 | | 222 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 7.624 | ¥ | 820.600 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | ¥ 820.600 | $ 7.642 | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,00 |
| | 04/2020 | DKK 14.005 | 2.192 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 04/2020 | $ 227 | DKK 1.457 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 1.011 | $ (3.883) | $ (2.872) | (0,53) |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und G Institutional EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 8.747 | $ 9.936 | $ 0 | $ (24) | $ (24) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 9.748 | € 8.557 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € 8.187 | $ 9.305 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 57 | € 51 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | 9.038 | 7.929 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | 9.637 | 8.617 | 176 | 0 | 176 | 0,03 |
| CBK | 07/2019 | € 8.803 | $ 10.005 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 267 | € 235 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | 9.749 | 8.557 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € 85 | $ 95 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 506 | € 453 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 9.636 | 8.617 | 177 | 0 | 177 | 0,03 |
| RBC | 07/2019 | € 5 | $ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | 112 | 127 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 872 | 980 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 16 | € 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € 41 | $ 46 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ 9.636 | € 8.617 | 178 | 0 | 178 | 0,03 |
| | | | | $ 598 | $ (78) | $ 520 | 0,09 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | £ 113 | $ 144 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 177 | £ 140 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 3.555 | $ 4.509 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 4.516 | £ 3.555 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | £ 3.559 | $ 4.522 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 3.370 | £ 2.659 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08/2019 | 4.529 | 3.559 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | £ 191 | $ 241 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | $ 3.250 | £ 2.546 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 3.366 | 2.659 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 3.364 | 2.662 | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| | | | | $ 82 | $ (35) | $ 47 | 0,01 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 10.725** | **1,99** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 12.600 $ | $ (12.698) | (2,36) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (12.698)** | **(2,36)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 820.087** | **152,54** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (282.473)** | **(52,54)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 537.614** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(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) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 188.175 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 1.737 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 4.750 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 2.600 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(g) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 2,550 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 4.800 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 | $ (4.907) | $ 4.800 | $ 4.801 | 0,89 |
| FICC | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 2.133 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | (2.178) | 2.133 | 2.133 | 0,40 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (7.085)** | **$ 6.933** | **$ 6.934** | **1,29** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 24.071 | $ 803.248 | $ 0 | $ 827.319 |
| Finanzderivate[3] | (2.132) | 7.598 | 0 | 5.466 |
| Leerverkäufe | 0 | (12.698) | 0 | (12.698) |
| **Summen** | **$ 21.939** | **$ 798.148** | **$ 0** | **$ 820.087** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 23.936 | $ 881.828 | $ 0 | $ 905.764 |
| Finanzderivate[3] | (3.016) | (27.171) | 0 | (30.187) |
| Leerverkäufe | 0 | (6.434) | 0 | (6.434) |
| **Summen** | **$ 20.920** | **$ 848.223** | **$ 0** | **$ 869.143** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BSN | 2,560 % | 07.06.2019 | 11.07.2019 | $ (17.573) | $ (17.603) | (3,27) |
| GRE | 2,560 | 17.05.2019 | 17.07.2019 | (21.848) | (21.918) | (4,08) |
| | 2,610 | 30.04.2019 | 22.07.2019 | (3.284) | (3.298) | (0,61) |
| IND | 2,600 | 06.06.2019 | 18.07.2019 | (14.032) | (14.057) | (2,62) |
| | 2,620 | 12.06.2019 | 12.07.2019 | (3.362) | (3.367) | (0,63) |
| | 2,620 | 19.06.2019 | 12.07.2019 | (6.993) | (6.999) | (1,30) |
| SCX | 2,570 | 15.05.2019 | 15.07.2019 | (8.353) | (8.381) | (1,56) |
| | 2,580 | 15.05.2019 | 15.07.2019 | (29.973) | (30.074) | (5,59) |
| | 2,600 | 24.04.2019 | 24.07.2019 | (80.582) | (80.977) | (15,06) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (186.674)** | **(34,72)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (2.407) | $ 2.230 | $ (177) |
| BPS | 1.395 | (1.820) | (425) |
| BRC | 166 | 0 | 166 |
| CBK | 3.996 | (5.240) | (1.244) |
| CIB | 603 | (770) | (167) |
| DUB | 30 | 0 | 30 |
| FBF | 302 | (280) | 22 |
| GLM | 130 | 0 | 130 |
| GST | 2.136 | (2.710) | (574) |
| HUS | (38) | 0 | (38) |
| JPM | 3.778 | (4.410) | (632) |
| MEI | 558 | (710) | (152) |
| MYC | (13) | (96) | (109) |
| MYI | 177 | 0 | 177 |
| RYL | (1) | 0 | (1) |
| SAL | (1) | 0 | (1) |
| SCX | (362) | 370 | 8 |
| SOG | 69 | 0 | 69 |
| SSB | 22 | 0 | 22 |
| TOR | 178 | 0 | 178 |
| UAG | 7 | 0 | 7 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 112,00 | 76,84 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 41,11 | 95,77 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,78 | 1,21 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,40) | (0,58) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,58) | (0,16) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,99 | (5,05) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,36) | (1,24) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (34,72) | (55,11) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,14 | 0,41 |
| Australien | 1,56 | 1,74 |
| Brasilien | 0,05 | 0,05 |
| Kanada | 1,03 | 1,02 |
| Cayman-Inseln | 3,82 | 4,37 |
| Dänemark | 4,73 | 0,37 |
| Frankreich | 11,30 | 9,14 |
| Deutschland | 0,32 | 0,32 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,10 | 0,10 |
| Indien | 0,09 | 0,10 |
| Irland | 5,16 | 5,29 |
| Italien | 7,61 | 8,63 |
| Japan | 1,86 | 0,62 |
| Niederlande | 1,39 | 1,41 |
| Neuseeland | 0,36 | 0,36 |
| Peru | 0,37 | 0,34 |
| Katar | 0,29 | 0,28 |
| Saudi-Arabien | 0,06 | 0,06 |
| Spanien | 2,16 | 0,75 |
| Schweden | 0,50 | 0,54 |
| Schweiz | 0,76 | 0,78 |
| Thailand | 0,00 | 0,11 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,00 | 0,04 |
| Großbritannien | 11,86 | 6,84 |
| Vereinigte Staaten | 96,51 | 105,13 |
| Kurzfristige Instrumente | 1,86 | 25,02 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,40) | (0,56) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | (0,02) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,03) | 0,02 |
| Zinsswaps | (0,55) | (0,18) |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,01) |
| Zinscaps | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,01 | 0,00 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 2,40 | (4,60) |
| Devisenterminkontrakte | (0,53) | (0,44) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,10 | 0,01 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,36) | (1,24) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (52,54) | (66,79) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | PAR (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | |
| 3,750 % fällig am 31.12.2038 | $ 800 | $ 470 | 0,32 |
| **ÖSTERREICH** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Eldorado Intl. Finance GmbH** | | | |
| 8,625 % fällig am 16.06.2021 | 500 | 526 | 0,36 |
| **BRASILIEN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **CSN Resources S.A.** | | | |
| 6,500 % fällig am 21.07.2020 | 600 | 618 | 0,42 |
| **KANADA** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Bausch Health Cos., Inc.** | | | |
| 7,000 % fällig am 15.01.2028 | 400 | 415 | 0,28 |
| **Bombardier, Inc.** | | | |
| 7,500 % fällig am 01.12.2024 | 1.100 | 1.125 | 0,77 |
| **Frontera Energy Corp.** | | | |
| 9,700 % fällig am 25.06.2023 | 800 | 855 | 0,58 |
| Summe Kanada | | 2.395 | 1,63 |
| **CAYMAN INSELN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **China Evergrande Group** | | | |
| 6,250 % fällig am 28.06.2021 | 900 | 866 | 0,59 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | |
| 7,500 % fällig am 09.03.2020 | 1.700 | 1.733 | 1,18 |
| **Health and Happiness International Holdings Ltd.** | | | |
| 7,250 % fällig am 21.06.2021 | 694 | 710 | 0,48 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | 1.000 | 996 | 0,68 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2026 | 300 | 301 | 0,20 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 | 1.755 | 1.694 | 1,15 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | 750 | 776 | 0,53 |
| **Sands China Ltd.** | | | |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | 1.700 | 1.826 | 1,24 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | |
| 8,625 % fällig am 27.07.2020 | 800 | 825 | 0,56 |
| **Transocean Guardian Ltd.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2024 | 284 | 289 | 0,20 |
| **Transocean Sentry Ltd.** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2023 | 800 | 803 | 0,55 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | 400 | 390 | 0,26 |
| Summe Cayman Inseln | | 11.209 | 7,62 |
| **FRANKREICH** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Altice France S.A.** | | | |
| 8,125 % fällig am 01.02.2027 | 500 | 526 | 0,36 |
| **DEUTSCHLAND** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | 150 | 152 | 0,10 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar oder 6,750 % PIK)** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2027 (a) | 500 | 504 | 0,34 |
| Summe Deutschland | | 656 | 0,44 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € 600 | 728 | 0,49 |
| **HONGKONG** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | |
| 4,071 % fällig am 25.05.2023 | $ 700 | $ 701 | 0,48 |
| **IRLAND** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Novatek OAO via Novatek Finance DAC** | | | |
| 4,422 % fällig am 13.12.2022 | 1.100 | 1.129 | 0,77 |
| | **ANZAHL** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (d)** | 4.000 | 406 | 0,28 |
| | **PARI (000S)** | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND ABTRETUNGEN** | | | |
| **AWAS Aviation Capital Ltd.** | | | |
| 4,870 % fällig am 03.10.2021 (f) | $ 843 | 854 | 0,58 |
| | **ANZAHL** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)** | 9.239 | 107 | 0,07 |
| Summe Irland | | 2.496 | 1,70 |
| | **PARI (000S)** | | |
| **LUXEMBURG** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(a) | $ 2.667 | 1.280 | 0,87 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | 600 | 622 | 0,42 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (b) | € 200 | 221 | 0,15 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | $ 1.100 | 1.174 | 0,80 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | 400 | 425 | 0,29 |
| | | 3.722 | 2,53 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND ABTRETUNGEN** | | | |
| **Ortho-Clinical Diagnostics S.A.** | | | |
| 5,680 % fällig am 30.06.2025 | 1.536 | 1.481 | 1,01 |
| Summe Luxemburg | | 5.203 | 3,54 |
| **NIEDERLANDE** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | |
| 7,375 % fällig am 29.05.2024 (c)(e) | € 700 | 841 | 0,57 |
| **Metinvest BV** | | | |
| 7,750 % fällig am 23.04.2023 | $ 550 | 570 | 0,39 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | |
| 1,700 % fällig am 19.07.2019 | 700 | 698 | 0,48 |
| 2,800 % fällig am 21.07.2023 | 900 | 781 | 0,53 |
| | | 2.890 | 1,97 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND ABTRETUNGEN** | | | |
| **Starfruit Finco BV** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.10.2025 | € 100 | 114 | 0,08 |
| 5,669 % fällig am 01.10.2025 | $ 100 | 99 | 0,06 |
| | | 213 | 0,14 |
| Summe Niederlande | | 3.103 | 2,11 |
| **SCHWEIZ** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Credit Suisse Group AG** | | | |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (c)(e) | 700 | 748 | 0,51 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (e) | $ 1.000 | $ 1.093 | 0,74 |
| **Barclays PLC** | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (c)(e) | £ 400 | 533 | 0,36 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | |
| 8,000 % fällig am 10.08.2025 (c)(e) | $ 400 | 433 | 0,30 |
| Summe Großbritannien | | 2.059 | 1,40 |
| **USA** | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,954 % fällig am 25.12.2045 ^ | 455 | 331 | 0,23 |
| **Argent Securities Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | 884 | 362 | 0,25 |
| 2,584 % fällig am 25.04.2036 | 303 | 127 | 0,09 |
| 2,684 % fällig am 25.04.2036 | 742 | 319 | 0,22 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,954 % fällig am 25.06.2036 | 600 | 599 | 0,41 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.12.2036 | 2.384 | 1.623 | 1,10 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,894 % fällig am 25.07.2035 | 275 | 277 | 0,19 |
| 3,829 % fällig am 25.10.2034 | 692 | 692 | 0,47 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 2,494 % fällig am 25.01.2037 | 521 | 357 | 0,24 |
| 2,524 % fällig am 25.12.2036 | 682 | 404 | 0,27 |
| 2,634 % fällig am 25.12.2046 | 881 | 564 | 0,38 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,644 % fällig am 25.08.2036 | 597 | 321 | 0,22 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,464 % fällig am 25.11.2037 | 87 | 45 | 0,03 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | 2.141 | 1.063 | 0,72 |
| 2,634 % fällig am 25.09.2036 | 75 | 43 | 0,03 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,504 % fällig am 25.04.2037 | 84 | 56 | 0,04 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 5,965 % fällig am 25.09.2046 ^ | 812 | 464 | 0,32 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 5,404 % fällig am 25.01.2033 ^ | 115 | 106 | 0,07 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | 1.094 | 605 | 0,41 |
| 2,704 % fällig am 25.06.2036 | 822 | 702 | 0,48 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,654 % fällig am 25.03.2037 | 691 | 412 | 0,28 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 2,864 % fällig am 25.12.2035 | 1.576 | 1.352 | 0,92 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 3,284 % fällig am 25.08.2034 | 705 | 659 | 0,45 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 3,364 % fällig am 25.01.2036 ^ | 286 | 228 | 0,15 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.07.2037 | 406 | 375 | 0,25 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2037 | 699 | 430 | 0,29 |
| | | 12.516 | 8,51 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | |
| 3,875 % fällig am 21.05.2024 | 400 | 410 | 0,28 |
| **Anheuser-Busch Cos. LLC** | | | |
| 4,900 % fällig am 01.02.2046 | 500 | 558 | 0,38 |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2028 (c) | 900 | 940 | 0,64 |
| **Beacon Roofing Supply, Inc.** | | | |
| 4,875 % fällig am 01.11.2025 | 1.900 | 1.888 | 1,28 |
| **Blue Racer Midstream LLC** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.07.2026 | 1.400 | 1.417 | 0,96 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2021 | 450 | 442 | 0,30 |
| 6,250 % fällig am 31.03.2023 | 300 | 290 | 0,20 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2026 | 500 | 482 | 0,33 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2024 | 400 | 401 | 0,27 |

| BESCHREIBUNG | | PAR (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Dell International LLC** | | | | |
| 6,020 % fällig am 15.06.2026 | $ | 1.100 | $ 1.214 | 0,83 |
| **Diamond Resorts International, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | | 1.400 | 1.447 | 0,98 |
| **DriveTime Automotive Group, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.06.2021 | | 425 | 431 | 0,29 |
| **Flagstar Bancorp, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.07.2021 | | 1.100 | 1.161 | 0,79 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,219 % fällig am 09.01.2022 | | 600 | 600 | 0,41 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 400 | 430 | 0,29 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 100 | 103 | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 15.03.2022 | | 775 | 807 | 0,55 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.11.2024 | | 100 | 86 | 0,06 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.08.2024 | | 300 | 296 | 0,20 |
| **Jeld-Wen, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.12.2027 | | 300 | 291 | 0,20 |
| **Kinetic Concepts Inc.** | | | | |
| 12,500 % fällig am 01.11.2021 | | 925 | 1.021 | 0,70 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | € | 1.000 | 1.237 | 0,84 |
| **Oxford Finance LLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.12.2022 | $ | 425 | 438 | 0,30 |
| **Quicken Loans, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | | 1.650 | 1.648 | 1,12 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 739 | 826 | 0,56 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 2.100 | 2.236 | 1,52 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 1.800 | 1.791 | 1,22 |
| **Staples, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2026 | | 300 | 299 | 0,20 |
| **Stearns Holdings LLC** | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.08.2020 | | 2.157 | 2.060 | 1,40 |
| **Triumph Group, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.04.2021 | | 1.100 | 1.089 | 0,74 |
| 5,250 % fällig am 01.06.2022 | | 100 | 98 | 0,07 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | | 1.450 | 1.387 | 0,94 |
| **Voyager Aviation Holdings LLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.08.2021 | | 2.095 | 2.132 | 1,45 |
| **Washington Prime Group LP** | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.08.2024 | | 700 | 666 | 0,45 |
| | | | 30.622 | 20,82 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Altra Industrial Motion Corp.** | | | | |
| 4,402 % fällig am 01.10.2025 | | 95 | 93 | 0,06 |
| **Brookfield Retail Holdings** | | | | |
| 4,902 % fällig am 27.08.2025 | | 496 | 486 | 0,33 |
| **Chobani LLC** | | | | |
| 5,902 % fällig am 10.10.2023 | | 693 | 684 | 0,47 |
| **Diamond Resorts Corp.** | | | | |
| 6,152 % fällig am 02.09.2023 | | 396 | 375 | 0,25 |
| **Envision Healthcare Corp.** | | | | |
| 6,152 % fällig am 10.10.2025 | | 498 | 433 | 0,29 |
| **NCI Building Systems, Inc.** | | | | |
| 6,354 % fällig am 12.04.2025 | $ | 1.393 | $ 1.358 | 0,92 |
| **VFH Parent LLC** | | | | |
| 6,044 % fällig am 01.03.2026 | | 97 | 97 | 0,07 |
| **XPO Logistics, Inc.** | | | | |
| 4,402 % fällig am 24.02.2025 | | 200 | 199 | 0,14 |
| 4,883 % fällig am 24.02.2025 | | 200 | 201 | 0,14 |
| | | | 3.926 | 2,67 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Erie Tobacco Asset Securitization Corp., New York Revenue Bonds, Series 2005** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.06.2028 | | 100 | 100 | 0,07 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 338 | 304 | 0,21 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 393 | 373 | 0,25 |
| 6,000 % fällig am 26.07.2036 | | 369 | 413 | 0,28 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 4,333 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 121 | 117 | 0,08 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,417 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 34 | 30 | 0,02 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,573 % fällig am 20.09.2046 | | 24 | 21 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 12 | 11 | 0,01 |
| 3,704 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 23 | 19 | 0,01 |
| 3,904 % fällig am 25.08.2035 | | 25 | 25 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 490 | 409 | 0,28 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 220 | 218 | 0,15 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 2.274 | 1.653 | 1,12 |
| 13,188 % fällig am 25.07.2035 | | 286 | 356 | 0,24 |
| 18,782 % fällig am 25.09.2037 | | 434 | 650 | 0,44 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,006 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 408 | 393 | 0,27 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 15 | 12 | 0,01 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2035 | | 344 | 233 | 0,16 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 3,824 % fällig am 29.12.2037 | | 1.120 | 940 | 0,64 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 200 | 165 | 0,11 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2021 ^ | | 190 | 117 | 0,08 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.07.2047 | | 26 | 25 | 0,02 |
| 2,554 % fällig am 25.02.2047 | | 5.036 | 3.866 | 2,63 |
| 2,594 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 224 | 108 | 0,07 |
| 3,504 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 25 | 24 | 0,02 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,929 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 14 | 13 | 0,01 |
| **First Horizon Asset Securities, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 65 | 54 | 0,04 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.11.2036 | | 561 | 530 | 0,36 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.02.2037 | | 41 | 32 | 0,02 |
| 3,695 % fällig am 25.12.2034 | | 501 | 487 | 0,33 |
| 4,024 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 109 | 97 | 0,07 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 3,904 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 68 | 68 | 0,05 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 ^ | $ | 310 | $ 225 | 0,15 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 546 | 499 | 0,34 |
| 3,304 % fällig am 25.08.2047 ^ | | 367 | 330 | 0,22 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,703 % fällig am 25.11.2037 | | 342 | 293 | 0,20 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 46 | 39 | 0,03 |
| 3,154 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 1.026 | 747 | 0,51 |
| 4,609 % fällig am 25.07.2035 | | 5 | 5 | 0,00 |
| 4,830 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 31 | 28 | 0,02 |
| 5,165 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 268 | 154 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | | 391 | 286 | 0,19 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 547 | 360 | 0,25 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 157 | 146 | 0,10 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 2.415 | 2.036 | 1,38 |
| | | | 16.913 | 11,50 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 16,592 % fällig am 25.11.2055 | | 673 | 403 | 0,27 |
| **US-STAATSOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 100 | 110 | 0,08 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,000 % fällig am 31.05.2024 | | 6.830 | 6.911 | 4,70 |
| 2,375 % fällig am 29.02.2024 | | 2.600 | 2.674 | 1,82 |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 | | 8.692 | 8.983 | 6,11 |
| 2,500 % fällig am 31.01.2024 | | 2.500 | 2.582 | 1,75 |
| | | | 21.260 | 14,46 |
| | | ANZAHL | | |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | | |
| **Vistra Energy Corp. - Exp. 02.02.2024** | | 31.815 | 61 | 0,04 |
| Summe USA | | | 85.801 | 58,34 |
| | | PAR (000S) | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (g)** | | | | |
| | | | 12.278 | 8,35 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 12.278 | 8,35 |
| | | ANZAHL | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | | 1.377.958 | 13.800 | 9,38 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | $ 143.317 | 97,45 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 9 | $ (11) | (0,01) |
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Short | 09/2019 | 10 | (20) | (0,01) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 9 | (18) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 54 | 107 | 0,07 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 7 | (10) | (0,01) |
| | | | | $ 48 | 0,03 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 48** | **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 – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Anheuser-Busch InBev | (1,000) % | 20.12.2023 | € 1.300 | $ (5) | (0,01) |
| Arrow Electronics, Inc. | (1,000) | 20.06.2023 | $ 1.300 | (4) | 0,00 |
| International Business Machines Corp. | (1,000) | 20.12.2023 | 1.400 | (18) | (0,01) |
| Kohl's Corp. | (1,000) | 20.12.2023 | 700 | (5) | 0,00 |
| L Brands, Inc. | (1,000) | 20.12.2023 | 700 | (8) | (0,01) |
| Lowe's Cos., Inc. | (1,000) | 20.12.2023 | 700 | (3) | 0,00 |
| Macy's Retail Holdings, Inc. | (1,000) | 20.12.2023 | 800 | (13) | (0,01) |
| Southwest Airlines Co. | (1,000) | 20.06.2023 | 1.300 | (5) | 0,00 |
| Target Corp. | (1,000) | 20.06.2023 | 1.300 | (6) | (0,01) |
| | | | | $ (67) | (0,05) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| DISH DBS Corp. | 5,000 % | 20.12.2022 | $ 200 | $ 0 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 100 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 1 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Main 28 5-Year Index | (1,000) % | 20.12.2022 | € 3.700 | $ 9 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 1.300 | $ 10 | 0,01 |
| CDX.IG-31 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2023 | 4.800 | 32 | 0,02 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 24.700 | 78 | 0,05 |
| | | | | $ 120 | 0,08 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,880 % | 02.07.2019 | $ 500 | $ (2) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,940 | 02.07.2019 | 600 | (4) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 27.06.2024 | 500 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 28.06.2024 | 600 | (5) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,050 | 19.06.2024 | 500 | (6) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,060 | 21.06.2024 | 500 | (6) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,080 | 20.06.2024 | 500 | (7) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,080 | 26.06.2024 | 500 | (7) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,090 | 24.06.2024 | 500 | (7) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,100 | 18.06.2024 | 500 | (7) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,110 | 25.06.2024 | 500 | (8) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,160 | 12.06.2024 | 600 | (11) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,190 | 11.06.2024 | 600 | (11) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,200 | 05.06.2024 | 600 | (12) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,210 | 04.06.2024 | 600 | (12) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,210 | 12.06.2024 | 500 | (10) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,220 | 30.05.2024 | 600 | (12) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,220 | 10.06.2024 | 600 | (12) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,240 | 29.05.2024 | 600 | (13) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,240 | 31.05.2024 | 600 | (13) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 30.05.2024 | 600 | (13) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,270 | 06.06.2024 | 600 | (14) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 15.05.2024 | 600 | (14) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 28.05.2024 | 600 | (14) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 05.06.2024 | 600 | (14) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 17.05.2024 | 600 | (14) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 22.05.2024 | 600 | (15) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,310 | 24.05.2024 | 600 | (15) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,320 | 21.05.2024 | 600 | (15) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,330 | 20.05.2024 | 600 | (15) | (0,01) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,410 % | 11.04.2024 | $ 600 | $ (17) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,435 | 10.04.2024 | 600 | (18) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,475 | 10.04.2024 | 600 | (19) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,510 | 09.04.2024 | 100 | (3) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | € 1.300 | (71) | (0,05) |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | £ 11.200 | 239 | 0,16 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 3.100 | (320) | (0,22) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 20.09.2027 | ¥ 310.000 | (76) | (0,05) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 20.03.2028 | 39.100 | (11) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,415 | 25.03.2029 | 40.000 | (15) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,850 | 17.04.2024 | MXN 26.200 | 32 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,038 | 29.02.2024 | 20.700 | 33 | 0,02 |
| | | | | | $ (559) | (0,38) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (496)** | **(0,34)** |

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

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,107 % | 12.09.2019 | 8.200 | $ 39 | $ 224 | 0,15 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,940 | 18.02.2020 | 6.300 | 46 | 161 | 0,11 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,945 | 09.12.2019 | 800 | 38 | 1 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,945 | 11.12.2019 | 300 | 14 | 1 | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 10.09.2019 | 8.200 | 38 | 215 | 0,15 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,120 | 13.09.2019 | 8.200 | 38 | 226 | 0,16 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,930 | 09.12.2019 | 1.100 | 51 | 2 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,943 | 12.12.2019 | 300 | 14 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 278 | $ 831 | 0,57 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 400 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 300 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 400 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 | 21.08.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 400 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.100 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 400 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 400 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 | 21.08.2019 | 1.200 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 400 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 400 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,900 | 17.06.2020 | 700 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,800 | 17.07.2019 | 500 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 3,000 | 17.06.2020 | 700 | (1) | 0 | 0,00 |
| JLN | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 300 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (13) | $ (2) | 0,00 |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 % | 09.12.2019 | 3.500 | $ (38) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 11.12.2019 | 1.300 | (14) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,100 | 12.09.2019 | 1.800 | (38) | (186) | (0,13) |
| | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,086 | 18.02.2020 | 600 | (46) | (115) | (0,08) |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,790 | 11.07.2019 | 500 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,070 | 11.07.2019 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 09.12.2019 | 4.800 | (50) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 12.12.2019 | 1.300 | (14) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,990 | 12.07.2019 | 300 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,230 | 12.07.2019 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,055 | 10.09.2019 | 1.800 | (38) | (179) | (0,12) |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,100 | 13.09.2019 | 1.800 | (38) | (186) | (0,13) |
| MYC | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,880 | 01.07.2019 | 600 | (1) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,160 | 01.07.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (282) | $ (675) | (0,46) |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Mexico Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 2.200 | $ 25 | $ (25) | $ (0) | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 % | 20.12.2023 | $ 100 | $ 10 | $ 6 | $ 16 | 0,01 |
| GST | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 200 | 23 | 8 | 31 | 0,02 |
| JPM | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 300 | 39 | 8 | 47 | 0,03 |
| | | | | | $ 72 | $ 22 | $ 94 | 0,06 |

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

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 33 | $ | 37 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 400 | | 510 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 137 | ARS | 6.893 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 11 | | 512 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € | 3.707 | $ | 4.146 | 0 | (75) | (75) | (0,05) |
| CBK | 07/2019 | | 29 | | 33 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 6.900 | | 63 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 2.936 | | 884 | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 174 | ARS | 8.496 | 18 | 0 | 18 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 3.966 | € | 3.490 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 891 | PEN | 2.936 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 3.490 | $ | 3.977 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 09/2019 | PEN | 2.936 | | 888 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | COP | 1.113.540 | | 350 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 18 | | 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 59 | HUF | 16.736 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 175 | PLN | 654 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 149 | ZAR | 2.114 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 726 | BRL | 2.811 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 721 | RUB | 47.469 | 24 | 0 | 24 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 487 | IDR | 7.141.320 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 10/2019 | | 348 | COP | 1.113.540 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | ARS | 25.612 | $ | 516 | 0 | (63) | (63) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 206 | ARS | 10.223 | 25 | 0 | 25 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 8 | € | 7 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | 07/2019 | HUF | 14.855 | $ | 54 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 315 | € | 279 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 188 | PLN | 703 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 210 | ZAR | 3.063 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| SCX | 07/2019 | | 733 | £ | 579 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | £ | 580 | $ | 733 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ | 329 | COP | 1.113.540 | 17 | 0 | 17 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 30 | MXN | 589 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 64 | ¥ | 6.900 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 6.900 | $ | 64 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 804 | | 116 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 155 | $ (167) | $ (12) | (0,01) |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | $ | 7.359 | CHF | 7.381 | $ 211 | $ 0 | $ 211 | 0,15 |
| BPS | 07/2019 | | 101 | | 100 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF | 7.508 | $ | 7.667 | 0 | (33) | (33) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 7.352 | CHF | 7.368 | 205 | 0 | 205 | 0,14 |
| | 08/2019 | | 7.690 | | 7.508 | 33 | 0 | 33 | 0,02 |
| GLM | 07/2019 | | 7.368 | | 7.415 | 239 | 0 | 239 | 0,16 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 7.513 | $ | 7.690 | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 7.712 | CHF | 7.513 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | | 171 | | 168 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 706 | $ (49) | $ 657 | 0,45 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) thesaurierend 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 | 07/2019 | € | 19.216 | $ | 21.837 | $ 0 | $ (47) | $ (47) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ | 21.893 | € | 19.216 | 46 | 0 | 46 | 0,03 |
| BPS | 07/2019 | € | 19.050 | $ | 21.659 | 0 | (34) | (34) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 107 | € | 94 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 21.682 | | 19.021 | 34 | 0 | 34 | 0,02 |
| BRC | 07/2019 | | 21.377 | | 19.114 | 390 | 0 | 390 | 0,26 |
| CBK | 07/2019 | € | 19.216 | $ | 21.839 | 0 | (44) | (44) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 45 | € | 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 21.895 | | 19.216 | 44 | 0 | 44 | 0,03 |
| GLM | 07/2019 | € | 40 | $ | 44 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | $ | 21.272 | € | 19.024 | 393 | 0 | 393 | 0,27 |
| RYL | 07/2019 | € | 121 | $ | 136 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 401 | € | 355 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 77 | $ | 86 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 21 | | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ | 21.374 | € | 19.114 | 394 | 0 | 394 | 0,27 |
| | | | | | | $ 1.304 | $ (128) | $ 1.176 | 0,80 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 2.069** | **1,41** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 500 | $ (504) | (0,34) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (504)** | **(0,34)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 144.434** | **98,21** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 2.626** | **1,79** |
| **Nettovermögen** | | **$ 147.060** | **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) Nullkuponwertpapier.

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

(d) Mit dem Fonds verbunden.

(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(f) Eingeschränkte Wertpapiere:

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| AWAS Aviation Capital Ltd. | 4,870 % | 03.10.2021 | 02.10.2014 | $ 843 | $ 854 | 0,58 |

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 140 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 1.340 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

(g) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 978 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | $ (998) | $ 978 | $ 978 | 0,67 |
| MBC | 2,680 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 11.300 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 30.04.2024 | (11.673) | 11.300 | 11.303 | 7,68 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (12.671)** | **$ 12.278** | **$ 12.281** | **8,35** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 14.375 | $ 127.685 | $ 1.257 | $ 143.317 |
| Finanzderivate[3] | 48 | 1.573 | 0 | 1.621 |
| Leerverkäufe | 0 | (504) | 0 | (504) |
| **Summen** | **$ 14.423** | **$ 128.754** | **$ 1.257** | **$ 144.434** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 14.466 | $ 123.760 | $ 2.573 | $ 140.799 |
| Finanzderivate[3] | 99 | (124) | 0 | (25) |
| **Summen** | **$ 14.565** | **$ 123.636** | **$ 2.573** | **$ 140.774** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 296 | $ (270) | $ 26 |
| BPS | 20 | 0 | 20 |
| BRC | 315 | (270) | 45 |
| CBK | 228 | 0 | 228 |
| GLM | 357 | (290) | 67 |
| GST | 31 | 0 | 31 |
| HUS | (38) | 0 | (38) |
| JPM | 60 | 0 | 60 |
| MYC | (4) | 0 | (4) |
| MYI | 393 | (410) | (17) |
| RYL | 2 | 0 | 2 |
| SCX | 3 | 0 | 3 |
| SSB | (4) | 0 | (4) |
| TOR | 411 | (290) | 121 |
| UAG | (1) | 0 | (1) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 34,89 | 25,69 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 54,21 | 63,30 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 8,35 | 10,45 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,03 | 0,07 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,34) | (0,35) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,41 | 0,27 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,34) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,32 | 0,40 |
| Österreich | 0,36 | 0,00 |
| Brasilien | 0,42 | 0,68 |
| Kanada | 1,63 | 1,00 |
| Cayman-Inseln | 7,62 | 11,06 |
| Frankreich | 0,36 | 0,43 |
| Deutschland | 0,44 | 0,10 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,49 | 0,00 |
| Hongkong | 0,48 | 0,56 |
| Irland | 1,70 | 1,34 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,00 | 0,43 |
| Luxemburg | 3,54 | 2,28 |
| Niederlande | 2,11 | 0,92 |
| Peru | 0,00 | 0,60 |
| Spanien | 0,00 | 0,53 |
| Schweiz | 0,51 | 0,48 |
| Großbritannien | 1,40 | 1,41 |
| Vereinigte Staaten | 58,34 | 56,90 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,00 | 0,14 |
| Kurzfristige Instrumente | 8,35 | 10,69 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 9,38 | 9,49 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,03 | 0,07 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | (0,05) | 0,06 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,01 | 0,03 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,08 | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,38) | (0,42) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | 0,00 | 0,01 |
| Zinsswapoption | 0,57 | 0,32 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,02) |
| Zinsswapoption | (0,46) | (0,28) |
| 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 | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,06 | (0,01) |
| Devisenterminkontrakte | (0,01) | 0,01 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,25 | 0,25 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,34) | 0,00 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 1,79 | 0,57 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | € | 8.300 | $ | 7.403 | 0,09 |
| 3,380 % fällig am 31.12.2038 | | 144.980 | | 94.376 | 1,09 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2027 | | 14.600 | | 12.197 | 0,14 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | | 10.100 | | 8.407 | 0,10 |
| Summe Argentinien | | | | 122.383 | 1,42 |
| **AUSTRALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.03.2028 | $ | 1.000 | | 1.022 | 0,01 |
| **ÖSTERREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Erste Group Bank AG** | | | | | |
| 8,875 % fällig am 15.10.2021 (h)(j) | € | 400 | | 524 | 0,01 |
| **IMMOFINANZ AG** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 27.01.2023 | | 3.700 | | 4.407 | 0,05 |
| Summe Österreich | | | | 4.931 | 0,06 |
| **BERMUDA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Bacardi Ltd.** | | | | | |
| 4,700 % fällig am 15.05.2028 | $ | 24.840 | | 26.597 | 0,31 |
| **BRASILIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 10.10.2022 | | 2.840 | | 2.898 | 0,03 |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.07.2019 (f)(h) | | 13.194 | | 145 | 0,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | | |
| 5,299 % fällig am 27.01.2025 | | 42.604 | | 45.309 | 0,53 |
| 5,375 % fällig am 01.10.2029 | £ | 700 | | 930 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | | 4.900 | | 7.056 | 0,08 |
| 7,375 % fällig am 17.01.2027 | $ | 9.700 | | 11.116 | 0,13 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 21.11.2036 | | 800 | | 965 | 0,01 |
| Summe Brasilien | | | | 68.419 | 0,79 |
| **KANADA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 7.000 | | 8.555 | 0,10 |
| 4,850 % fällig am 17.04.2028 | $ | 200 | | 211 | 0,00 |
| **Fairstone Financial, Inc.** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.07.2024 (c) | | 3.400 | | 3.474 | 0,04 |
| **Harvest Operations Corp.** | | | | | |
| 2,330 % fällig am 14.04.2021 | | 2.700 | | 2.687 | 0,03 |
| | | | | 14.927 | 0,17 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | | |
| 5,412 % fällig am 02.06.2025 | | 4.405 | | 4.408 | 0,05 |
| Summe Kanada | | | | 19.335 | 0,22 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Apex Credit CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,632 % fällig am 27.10.2028 | | 4.400 | | 4.405 | 0,05 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | | |
| 3,922 % fällig am 20.04.2026 | | 3.100 | | 3.112 | 0,04 |
| | | | | 7.517 | 0,09 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **21Vianet Group, Inc.** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2021 | | 2.900 | | 2.992 | 0,03 |
| **Air 2 U.S.** | | | | | |
| 8,027 % fällig am 01.10.2020 | $ | 6 | $ | 6 | 0,00 |
| **Ambac LSNI LLC** | | | | | |
| 7,319 % fällig am 12.02.2023 | | 62 | | 63 | 0,00 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2023 | | 2.400 | | 2.546 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | | 4.400 | | 4.702 | 0,05 |
| **Baidu, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 29.09.2023 | | 400 | | 415 | 0,00 |
| **China Evergrande Group** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 10.900 | | 10.536 | 0,12 |
| 9,500 % fällig am 11.04.2022 | | 21.300 | | 21.163 | 0,25 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.04.2024 | | 6.800 | | 7.017 | 0,08 |
| **Lima Metro Line Finance Ltd.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 6.200 | | 6.611 | 0,08 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 3.600 | | 3.585 | 0,04 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | | 9.929 | | 9.880 | 0,11 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 (d) | | 25.412 | | 15.820 | 0,18 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 | | 103 | | 99 | 0,00 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | | |
| 7,720 % fällig am 01.12.2026 (d) | | 421 | | 107 | 0,00 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2021 | | 800 | | 809 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 20.500 | | 21.211 | 0,25 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 2.850 | | 3.016 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | | 1.700 | | 1.835 | 0,02 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 44.200 | | 44.308 | 0,51 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 35.000 | | 35.087 | 0,41 |
| **Sands China Ltd.** | | | | | |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 4.600 | | 5.007 | 0,06 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.08.2020 | | 900 | | 912 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 | | 22.200 | | 22.212 | 0,26 |
| 7,950 % fällig am 11.10.2023 | | 19.500 | | 19.652 | 0,23 |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 | | 900 | | 924 | 0,01 |
| 8,375 % fällig am 15.01.2021 | | 1.400 | | 1.450 | 0,02 |
| 8,625 % fällig am 27.07.2020 | | 4.100 | | 4.228 | 0,05 |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** | | | | | |
| 1,544 % fällig am 28.07.2038 | £ | 4.100 | | 4.690 | 0,05 |
| 8,280 % fällig am 28.10.2022 | | 77 | | 107 | 0,00 |
| **Transocean Guardian Ltd.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2024 | $ | 8.376 | | 8.554 | 0,10 |
| **Transocean Poseidon Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.02.2027 | | 1.800 | | 1.907 | 0,02 |
| **UPCB Finance Ltd.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2027 | € | 17.010 | | 20.456 | 0,24 |
| | | | | 281.907 | 3,26 |
| Summe Cayman Inseln | | | | 289.424 | 3,35 |
| **CHILE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **GNL Quintero S.A.** | | | | | |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029 | $ | 4.400 | | 4.675 | 0,05 |
| **CHINA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 29.09.2019 | | 1.500 | | 1.498 | 0,02 |
| **KOLUMBIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Colombia Government International Bond** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045 | | 52.900 | | 58.507 | 0,68 |
| 5,625 % fällig am 26.02.2044 | | 2.600 | | 3.083 | 0,03 |
| 6,125 % fällig am 18.01.2041 | | 100 | | 124 | 0,00 |
| Summe Kolumbien | | | | 61.714 | 0,71 |
| **COSTA RICA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Costa Rica Government International Bond** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 04.04.2044 | $ | 1.600 | $ | 1.594 | 0,02 |
| 7,158 % fällig am 12.03.2045 | | 600 | | 604 | 0,01 |
| Summe Costa Rica | | | | 2.198 | 0,03 |
| **KROATIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Croatia Government International Bond** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 19.06.2029 | € | 3.300 | | 3.767 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 14.07.2020 | $ | 2.800 | | 2.912 | 0,04 |
| Summe Kroatien | | | | 6.679 | 0,08 |
| **CURACAO** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Teva Pharmaceutical Finance BV** | | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | | 3.700 | | 3.587 | 0,04 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Co. BV** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 18.12.2022 | | 2.684 | | 2.452 | 0,03 |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | | 18.901 | | 18.263 | 0,21 |
| Summe Curacao | | | | 24.302 | 0,28 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Dominican Republic International Bond** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.02.2048 | | 13.400 | | 14.204 | 0,17 |
| 6,850 % fällig am 27.01.2045 | | 9.700 | | 10.639 | 0,12 |
| 6,875 % fällig am 29.01.2026 | | 1.800 | | 2.038 | 0,02 |
| Summe Dominikanische Republik | | | | 26.881 | 0,31 |
| **ECUADOR** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ecuador Government International Bond** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 23.01.2028 | | 6.200 | | 6.154 | 0,07 |
| 8,875 % fällig am 23.10.2027 | | 9.200 | | 9.603 | 0,11 |
| 9,650 % fällig am 13.12.2026 | | 5.300 | | 5.750 | 0,07 |
| 10,750 % fällig am 28.03.2022 | | 10.600 | | 11.938 | 0,14 |
| 10,750 % fällig am 31.01.2029 | | 6.900 | | 7.806 | 0,09 |
| Summe Ecuador | | | | 41.251 | 0,48 |
| **ÄGYPTEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Egypt Government International Bond** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 11.04.2025 | € | 15.700 | | 18.306 | 0,21 |
| 4,750 % fällig am 16.04.2026 | | 4.300 | | 4.931 | 0,06 |
| 5,625 % fällig am 16.04.2030 | | 1.500 | | 1.675 | 0,02 |
| 6,375 % fällig am 11.04.2031 | | 8.100 | | 9.405 | 0,11 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2047 | $ | 10.000 | | 10.625 | 0,12 |
| Summe Ägypten | | | | 44.942 | 0,52 |
| **FRANKREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Altice France S.A.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.02.2027 | € | 1.500 | | 1.854 | 0,02 |
| 7,375 % fällig am 01.05.2026 | $ | 51.211 | | 52.619 | 0,61 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | | 2.200 | | 2.386 | 0,03 |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 54.200 | | 58.186 | 0,67 |
| 5,198 % fällig am 10.01.2030 | | 5.600 | | 6.419 | 0,08 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 21.09.2028 | | 6.600 | | 7.244 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 13.10.2035 | | 1.000 | | 1.094 | 0,01 |
| **La Mondiale SAM** | | | | | |
| 5,050 % fällig am 17.12.2025 (h) | € | 13.765 | | 17.640 | 0,20 |
| | | | | 147.442 | 1,70 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **Altice France S.A.** | | | | | |
| 6,394 % fällig am 14.08.2026 | $ | 11.960 | | 11.737 | 0,14 |
| **Numericable Group S.A.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2026 | € | 15.196 | | 16.775 | 0,19 |
| 5,152 % fällig am 31.07.2025 | $ | 7.282 | | 6.954 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 6,082 % fällig am 31.01.2026 | $ | 1.583 | $ 1.540 | 0,02 |
| | | | 37.006 | 0,43 |
| Summe Frankreich | | | 184.448 | 2,13 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADLER Real Estate AG** | | | | |
| 3,000 % fällig am 27.04.2026 | € | 1.500 | 1.777 | 0,02 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,180 % fällig am 07.12.2020 | | 5.000 | 5.630 | 0,07 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 11.200 | 12.865 | 0,15 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2020 | £ | 200 | 254 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | € | 5.600 | 6.475 | 0,08 |
| 3,150 % fällig am 22.01.2021 | $ | 3.900 | 3.872 | 0,05 |
| 3,300 % fällig am 16.11.2022 | | 100 | 98 | 0,00 |
| 3,375 % fällig am 12.05.2021 | | 10.900 | 10.857 | 0,13 |
| 3,875 % fällig am 12.02.2024 | £ | 20.600 | 26.897 | 0,31 |
| 3,950 % fällig am 27.02.2023 | $ | 100 | 100 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 04.02.2021 | | 6.150 | 6.206 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 53.975 | 54.737 | 0,63 |
| 5,000 % fällig am 14.02.2022 | | 9.900 | 10.209 | 0,12 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (d) | € | 6.900 | 8.052 | 0,09 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (d) | | 29.850 | 34.534 | 0,40 |
| **ProSiebenSat.1 Media SE** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2021 | | 2.000 | 2.361 | 0,03 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 2,875 % fällig am 26.03.2027 | | 2.800 | 3.472 | 0,04 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,250 % fällig am 10.06.2024 | | 12.000 | 13.963 | 0,16 |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 100 | 120 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 31.07.2026 | | 200 | 247 | 0,00 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,875 % fällig am 12.04.2023 | | 1.600 | 1.846 | 0,02 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.01.2024 | | 17.300 | 21.366 | 0,25 |
| | | | 225.938 | 2,62 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2027 | | 7.100 | 8.095 | 0,09 |
| Summe Deutschland | | | 234.033 | 2,71 |
| **GHANA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ghana Government International Bond** | | | | |
| 7,875 % fällig am 26.03.2027 | $ | 5.600 | 5.908 | 0,07 |
| 8,125 % fällig am 26.03.2032 | | 4.200 | 4.278 | 0,05 |
| 8,950 % fällig am 26.03.2051 | | 5.000 | 5.190 | 0,06 |
| Summe Ghana | | | 15.376 | 0,18 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 10.233 | 10.664 | 0,13 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 20.06.2022 | € | 4.500 | 5.441 | 0,06 |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | | 12.139 | 14.715 | 0,17 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | 30.820 | 0,36 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CNOOC Finance Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 09.05.2023 | $ | 2.900 | 2.929 | 0,03 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 03.07.2029 (c) | | 2.300 | 2.337 | 0,03 |
| **ONGC Videsh Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.07.2019 | | 1.200 | 1.200 | 0,01 |
| | | | 3.537 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 3,375 % fällig am 05.08.2026 | $ | 5.900 | $ 5.919 | 0,07 |
| Summe Indien | | | 9.456 | 0,11 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Pelabuhan Indonesia Persero PT** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 5.700 | 6.110 | 0,07 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 6,500 % fällig am 07.11.2048 | | 34.000 | 42.113 | 0,49 |
| **Perusahaan Listrik Negara PT** | | | | |
| 5,450 % fällig am 21.05.2028 | | 1.600 | 1.776 | 0,02 |
| | | | 49.999 | 0,58 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 1,450 % fällig am 18.09.2026 | € | 6.500 | 7.581 | 0,09 |
| 3,375 % fällig am 30.07.2025 | | 1.100 | 1.420 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 14.06.2028 | | 19.300 | 26.297 | 0,30 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** | | | | |
| 3,400 % fällig am 29.03.2022 | $ | 2.500 | 2.541 | 0,03 |
| | | | 37.839 | 0,44 |
| Summe Indonesien | | | 87.838 | 1,02 |
| **IRLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € | 8.800 | 10.145 | 0,12 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.02.2022 | $ | 27.100 | 27.892 | 0,32 |
| 4,250 % fällig am 01.07.2020 | | 450 | 457 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | | 800 | 825 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 4.200 | 4.308 | 0,05 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (h)(j) | € | 4.700 | 5.660 | 0,06 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | $ | 600 | 597 | 0,01 |
| 3,373 % fällig am 15.11.2025 | | 300 | 304 | 0,00 |
| 4,418 % fällig am 15.11.2035 | | 4.000 | 3.966 | 0,05 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 24.05.2023 | £ | 3.300 | 4.664 | 0,05 |
| **James Hardie International Finance Co.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2026 | € | 5.000 | 6.055 | 0,07 |
| **Novatek OAO via Novatek Finance DAC** | | | | |
| 6,604 % fällig am 03.02.2021 | $ | 1.800 | 1.897 | 0,02 |
| **Russian Railways via RZD Capital PLC** | | | | |
| 7,487 % fällig am 25.03.2031 | £ | 9.698 | 15.322 | 0,18 |
| **Smurfit Kappa Acquisitions ULC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.01.2026 | € | 9.600 | 11.925 | 0,14 |
| | | | 94.017 | 1,09 |
| | | **ANZAHL** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (i)** | | 2.919.140 | 296.263 | 3,43 |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (i)** | | 2.136.098 | 22.643 | 0,26 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (i)** | | 27.488.514 | 277.359 | 3,21 |
| | | | 300.002 | 3,47 |
| Summe Irland | | | 690.282 | 7,99 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **INSEL MAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NE Property BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.05.2023 | € | 4.800 | $ 5.616 | 0,07 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | $ | 14.000 | 14.048 | 0,16 |
| 5,710 % fällig am 15.01.2026 | | 10.200 | 10.332 | 0,12 |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | | 33.131 | 34.880 | 0,41 |
| 7,000 % fällig am 19.01.2021 (h)(j) | € | 16.661 | 20.018 | 0,23 |
| **Leonardo SpA** | | | | |
| 8,000 % fällig am 16.12.2019 | £ | 14.300 | 18.757 | 0,22 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 3,750 % fällig am 12.04.2022 | $ | 900 | 911 | 0,01 |
| 6,497 % fällig am 14.01.2022 | | 4.600 | 4.787 | 0,06 |
| 6,572 % fällig am 14.01.2022 | | 5.450 | 5.796 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (h)(j) | € | 2.300 | 2.769 | 0,03 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 40.950 | 46.811 | 0,54 |
| **Wind Tre SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 20.01.2023 | € | 30.300 | 34.833 | 0,40 |
| 2,750 % fällig am 20.01.2024 | | 6.400 | 7.207 | 0,08 |
| 3,125 % fällig am 20.01.2025 | | 11.300 | 12.863 | 0,15 |
| Summe Italien | | | 214.012 | 2,48 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,190 % fällig am 13.09.2021 | $ | 900 | 896 | 0,01 |
| **SoftBank Group Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2028 | € | 32.900 | 42.610 | 0,49 |
| Summe Japan | | | 43.506 | 0,50 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 1.823 | 2.124 | 0,03 |
| 2,875 % fällig am 31.07.2043 | | 25.901 | 31.455 | 0,36 |
| 4,249 % fällig am 31.07.2043 | | 2.751 | 3.559 | 0,04 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 1.500 | 1.883 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 31.07.2043 | | 100 | 109 | 0,00 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 5.300 | 6.502 | 0,08 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 30.06.2022 | £ | 27.350 | 35.652 | 0,41 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 81.284 | 0,94 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kazakhstan Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 21.07.2025 | $ | 26.900 | 30.456 | 0,35 |
| 6,500 % fällig am 21.07.2045 | | 1.100 | 1.526 | 0,02 |
| Summe Kasachstan | | | 31.982 | 0,37 |
| **KENIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kenya Government International Bond** | | | | |
| 8,000 % fällig am 22.05.2032 | | 6.800 | 7.199 | 0,08 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.02.2023 | | 400 | 411 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 15.05.2026 | | 50.100 | 50.481 | 0,58 |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2025 | € | 7.600 | 8.628 | 0,10 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | | 12.610 | 14.756 | 0,17 |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | $ | 14.500 | 13.693 | 0,16 |
| 8,000 % fällig am 15.05.2027 | € | 3.300 | 3.832 | 0,04 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 14.100 | 15.266 | 0,18 |
| **Cirsa Finance International SARL** | | | | |
| 7,875 % fällig am 20.12.2023 | | 300 | 319 | 0,00 |

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

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(d) | $ | 1.820 | $ 874 | 0,01 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (9,000 % bar und 0,500 % PIK)** | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(d) | | 201 | 97 | 0,00 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 | € | 32.200 | 36.754 | 0,43 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | | 4.800 | 5.551 | 0,06 |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | | 2.300 | 2.687 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 14.600 | 15.131 | 0,18 |
| 4,875 % fällig am 16.07.2025 (h) | € | 1.800 | 2.032 | 0,02 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (f) | | 38.554 | 42.533 | 0,49 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | $ | 2.200 | 2.394 | 0,03 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 06.04.2024 | £ | 17.800 | 24.102 | 0,28 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2024 | € | 19.100 | 22.572 | 0,26 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | | 12.200 | 15.416 | 0,18 |
| **Nielsen Co. Luxembourg SARL** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2021 | $ | 40.200 | 40.451 | 0,47 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 12.500 | 13.293 | 0,15 |
| **Telenet Finance Luxembourg Notes SARL** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2028 | € | 9.600 | 11.356 | 0,13 |
| | | | 342.629 | 3,96 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Delos Finance SARL** | | | | |
| 4,080 % fällig am 06.10.2023 | $ | 500 | 500 | 0,01 |
| Summe Luxemburg | | | 343.129 | 3,97 |
| **MAZEDONIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **North Macedonia Government International Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.01.2025 | € | 1.600 | 1.924 | 0,02 |
| | | **ANZAHL** | | |
| **MEXIKO** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. (e)** | | 28.925 | 0 | 0,00 |
| **Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (e)** | | 9.536 | 1 | 0,00 |
| | | | 1 | 0,00 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027 | € | 15.950 | 15.960 | 0,18 |
| 3,750 % fällig am 21.02.2024 | | 9.900 | 11.240 | 0,13 |
| 4,750 % fällig am 26.02.2029 | | 38.300 | 41.819 | 0,48 |
| 4,875 % fällig am 21.02.2028 | | 17.800 | 19.874 | 0,23 |
| 6,500 % fällig am 13.03.2027 | $ | 6.600 | 6.533 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 19.100 | 17.739 | 0,21 |
| **Trust F** | | | | |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 3.700 | 3.802 | 0,04 |
| | | | 116.967 | 1,35 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 08.03.2044 | | 5.000 | 5.231 | 0,06 |
| Summe Mexiko | | | 122.199 | 1,41 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (h)(j) | € | 12.200 | 14.483 | 0,17 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (h)(j) | | 16.400 | 20.715 | 0,24 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 5,800 % fällig am 25.09.2023 | $ | 33.400 | 36.972 | 0,43 |
| **Koninklijke KPN NV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 17.09.2029 | £ | 100 | $ 148 | 0,00 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (h) | € | 20.600 | 25.964 | 0,30 |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.03.2024 | $ | 12.600 | 13.519 | 0,16 |
| 5,350 % fällig am 01.03.2026 | | 12.350 | 13.692 | 0,16 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 4.900 | 5.785 | 0,07 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | $ | 1.050 | 1.092 | 0,01 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 40.000 | 41.779 | 0,48 |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 3.700 | 3.853 | 0,04 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 15.10.2024 | € | 15.700 | 14.851 | 0,17 |
| 1,250 % fällig am 31.03.2023 | | 2.900 | 2.952 | 0,03 |
| 2,800 % fällig am 21.07.2023 | $ | 19.200 | 16.656 | 0,19 |
| 4,500 % fällig am 01.03.2025 | € | 11.300 | 12.387 | 0,14 |
| **VIVAT NV** | | | | |
| 2,375 % fällig am 17.05.2024 | | 3.355 | 4.059 | 0,05 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 16.11.2027 | | 4.700 | 5.833 | 0,07 |
| 3,250 % fällig am 18.11.2030 | | 15.000 | 19.421 | 0,23 |
| 4,125 % fällig am 16.11.2038 | | 10.400 | 14.456 | 0,17 |
| 4,625 % fällig am 27.06.2028 (h) | | 12.100 | 14.743 | 0,17 |
| **Ziggo BV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.01.2027 | | 10.300 | 12.480 | 0,14 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2027 | $ | 4.000 | 4.089 | 0,05 |
| | | | 299.929 | 3,47 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Sigma Bidco BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.07.2025 | € | 14.200 | 15.861 | 0,18 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **EMF-NL Prime BV** | | | | |
| 0,490 % fällig am 17.04.2041 | | 58 | 64 | 0,00 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 1,190 % fällig am 17.10.2040 | | 630 | 717 | 0,01 |
| | | | 781 | 0,01 |
| Summe Niederlande | | | 316.571 | 3,66 |
| **NIGERIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Nigeria Government International Bond** | | | | |
| 7,875 % fällig am 16.02.2032 | $ | 1.500 | 1.572 | 0,02 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aker BP ASA** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.06.2024 | | 8.400 | 8.679 | 0,10 |
| **OMAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Oman Government International Bond** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.03.2047 | | 17.900 | 15.514 | 0,18 |
| 6,750 % fällig am 17.01.2048 | | 27.500 | 24.336 | 0,28 |
| Summe Oman | | | 39.850 | 0,46 |
| **PANAMA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banistmo S.A.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 19.09.2022 | | 1.700 | 1.711 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Panama Government International Bond** | | | | |
| 6,700 % fällig am 26.01.2036 | | 21.700 | 29.620 | 0,34 |
| 8,125 % fällig am 28.04.2034 | | 600 | 853 | 0,01 |
| | | | 30.473 | 0,35 |
| Summe Panama | | | 32.184 | 0,37 |
| **POLEN** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **PCF GmbH** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | € | 26.300 | $ 29.327 | 0,34 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | | 200 | 56 | 0,00 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | $ | 13.750 | 16.095 | 0,19 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | |
| 5,838 % fällig am 30.09.2027 | | 13.350 | 15.179 | 0,18 |
| 6,332 % fällig am 30.09.2027 | | 3.270 | 3.755 | 0,04 |
| | | | 35.029 | 0,41 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Qatar National Bank SAQ** | | | | |
| 3,420 % fällig am 22.12.2020 | | 16.300 | 16.276 | 0,19 |
| **State Of Qatar** | | | | |
| 2,983 % fällig am 21.12.2020 | | 25.000 | 24.937 | 0,29 |
| | | | 41.213 | 0,48 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 4,500 % fällig am 23.04.2028 | | 4.600 | 5.154 | 0,06 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 5.300 | 6.327 | 0,07 |
| | | | 11.481 | 0,13 |
| Summe Katar | | | 87.723 | 1,02 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 19.04.2027 | € | 19.800 | 24.494 | 0,29 |
| 4,125 % fällig am 11.03.2039 | | 100 | 131 | 0,00 |
| Summe Rumänien | | | 24.625 | 0,29 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ALROSA Finance S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 09.04.2024 | $ | 3.200 | 3.321 | 0,04 |
| 7,750 % fällig am 03.11.2020 | | 200 | 212 | 0,00 |
| **Lukoil International Finance BV** | | | | |
| 7,250 % fällig am 05.11.2019 | | 800 | 813 | 0,01 |
| **MMK International Capital DAC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 13.06.2024 | | 9.300 | 9.441 | 0,11 |
| | | | 13.787 | 0,16 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 04.12.2025 | € | 30.700 | 37.484 | 0,44 |
| 5,625 % fällig am 04.04.2042 | $ | 2.400 | 2.820 | 0,03 |
| | | | 40.304 | 0,47 |
| Summe Russland | | | 54.091 | 0,63 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 4.400 | 4.458 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 35.700 | 38.053 | 0,44 |
| Summe Saudi-Arabien | | | 42.511 | 0,49 |
| **SENEGAL** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Senegal Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 13.03.2028 | € | 1.300 | 1.488 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 23.05.2033 | $ | 3.200 | 3.103 | 0,03 |
| Summe Senegal | | | 4.591 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARK-TWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **SÜDAFRIKA** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | $ 2.000 | $ 2.111 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | |
| 5,875 % fällig am 16.09.2025 | 51.000 | 55.979 | 0,65 |
| Summe Südafrika | | 58.090 | 0,67 |
| **SPANIEN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (h)(j) | € 2.000 | 2.397 | 0,03 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (h)(j) | 53.200 | 62.368 | 0,72 |
| 8,875 % fällig am 14.04.2021 (h)(j) | 400 | 509 | 0,01 |
| **Banco Santander S.A.** | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (h)(j) | 13.400 | 16.080 | 0,19 |
| **Bankinter S.A.** | | | |
| 0,875 % fällig am 08.07.2026 (c) | 6.900 | 7.849 | 0,09 |
| **CaixaBank S.A.** | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | 200 | 238 | 0,00 |
| 2,375 % fällig am 01.02.2024 | 1.500 | 1.829 | 0,02 |
| | | 91.270 | 1,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | 5.100 | 6.284 | 0,07 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | 4.300 | 5.037 | 0,06 |
| | | 11.321 | 0,13 |
| Summe Spanien | | 102.591 | 1,19 |
| **SCHWEDEN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Sagax AB** | | | |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | 300 | 356 | 0,01 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget Norden AB** | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2025 | 900 | 1.043 | 0,01 |
| Summe Schweden | | 1.399 | 0,02 |
| **SCHWEIZ** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (j) | $ 70.250 | 77.495 | 0,90 |
| **UBS AG** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (j) | 1.400 | 1.488 | 0,02 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (j) | 29.413 | 33.004 | 0,38 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | 1.900 | 2.029 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 15.04.2026 | 16.000 | 17.107 | 0,20 |
| Summe Schweiz | | 131.123 | 1,52 |
| **TRINIDAD UND TOBAGO** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Trinidad & Tobago Government International Bond** | | | |
| 4,500 % fällig am 04.08.2026 | 3.900 | 3.905 | 0,05 |
| **TUNESIEN** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Banque Centrale de Tunisie International Bond** | | | |
| 5,625 % fällig am 17.02.2024 | € 1.100 | 1.248 | 0,02 |
| 8,250 % fällig am 19.09.2027 | $ 1.050 | 1.044 | 0,01 |
| Summe Tunesien | | 2.292 | 0,03 |
| **TÜRKEI** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Turkiye Garanti Bankasi A/S** | | | |
| 4,750 % fällig am 17.10.2019 | 13.100 | 13.108 | 0,15 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Turkey Government International Bond** | | | |
| 4,625 % fällig am 31.03.2025 | € 13.700 | 15.587 | 0,18 |
| 4,875 % fällig am 09.10.2026 | $ 36.300 | $ 32.578 | 0,38 |
| 5,125 % fällig am 25.03.2022 | 65.100 | 64.290 | 0,74 |
| 5,125 % fällig am 17.02.2028 | 36.500 | 32.685 | 0,38 |
| 5,750 % fällig am 22.03.2024 | 29.300 | 28.648 | 0,33 |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047 | 5.300 | 4.456 | 0,05 |
| 6,125 % fällig am 24.10.2028 | 1.200 | 1.134 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 23.12.2023 | 2.700 | 2.795 | 0,03 |
| 7,625 % fällig am 26.04.2029 | 8.800 | 9.031 | 0,11 |
| | | 191.204 | 2,21 |
| Summe Türkei | | 204.312 | 2,36 |
| **UKRAINE** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | |
| 6,750 % fällig am 20.06.2026 | € 5.200 | 6.287 | 0,07 |
| 7,375 % fällig am 25.09.2032 | $ 5.800 | 5.718 | 0,07 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2019 | 44.400 | 44.620 | 0,52 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2020 | 27.900 | 28.854 | 0,33 |
| 8,994 % fällig am 01.02.2024 | 7.900 | 8.626 | 0,10 |
| 9,750 % fällig am 01.11.2028 | 11.000 | 12.450 | 0,14 |
| Summe Ukraine | | 106.555 | 1,23 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Avon International Capital PLC** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.08.2022 (c) | 4.300 | 4.343 | 0,05 |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (j) | 4.200 | 4.589 | 0,05 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ 35.784 | 52.378 | 0,61 |
| **Barclays PLC** | | | |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | 4.300 | 5.637 | 0,07 |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | 950 | 1.236 | 0,01 |
| 3,650 % fällig am 16.03.2025 | $ 500 | 504 | 0,01 |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | 6.500 | 6.729 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (h)(j) | € 5.200 | 5.995 | 0,07 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (h)(j) | £ 2.100 | 2.699 | 0,03 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (h)(j) | 7.800 | 10.363 | 0,12 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (h)(j) | 15.000 | 20.264 | 0,23 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (h)(j) | € 6.500 | 8.022 | 0,09 |
| **BAT International Finance PLC** | | | |
| 3,950 % fällig am 15.06.2025 | $ 1.700 | 1.761 | 0,02 |
| **British Telecommunications PLC** | | | |
| 9,625 % fällig am 15.12.2030 | 6.375 | 9.621 | 0,11 |
| **Co-operative Group Holdings Ltd.** | | | |
| 7,500 % fällig am 08.07.2026 Ø | £ 300 | 429 | 0,01 |
| **EI Group PLC** | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | 3.700 | 5.025 | 0,06 |
| 6,875 % fällig am 09.05.2025 | 7.400 | 10.189 | 0,12 |
| **Ensco Rowan PLC** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.10.2044 | $ 4.100 | 2.378 | 0,03 |
| 7,750 % fällig am 01.02.2026 | 200 | 150 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 31.01.2024 | 2.828 | 2.411 | 0,03 |
| **FCE Bank PLC** | | | |
| 0,189 % fällig am 26.08.2020 | € 700 | 794 | 0,01 |
| 0,869 % fällig am 13.09.2021 | 1.500 | 1.714 | 0,02 |
| 1,114 % fällig am 13.05.2020 | 200 | 230 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 24.06.2021 | 2.600 | 3.030 | 0,04 |
| **Greene King Finance PLC** | | | |
| 2,866 % fällig am 15.03.2036 | £ 2.400 | 2.451 | 0,03 |
| **HBOS PLC** | | | |
| 5,374 % fällig am 30.06.2021 | € 4.500 | 5.633 | 0,07 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | |
| 3,600 % fällig am 25.05.2023 | $ 6.200 | 6.455 | 0,07 |
| **INEOS Finance PLC** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.11.2025 | € 1.500 | 1.698 | 0,02 |
| 2,875 % fällig am 01.05.2026 | 18.300 | 21.153 | 0,24 |
| **John Lewis PLC** | | | |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | £ 1.300 | 1.866 | 0,02 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | 19.000 | 24.298 | 0,28 |
| 4,450 % fällig am 08.05.2025 | $ 2.900 | 3.090 | 0,04 |
| 6,375 % fällig am 27.06.2020 (h)(j) | € 600 | 710 | 0,01 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | |
| 3,000 % fällig am 08.12.2023 | £ 3.500 | 4.560 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 12.06.2025 | 1.700 | 2.358 | 0,03 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | |
| 1,236 % fällig am 15.12.2030 | £ 6.036 | $ 7.212 | 0,08 |
| 2,860 % fällig am 15.12.2030 | $ 2.085 | 1.948 | 0,02 |
| 6,469 % fällig am 15.09.2032 | £ 1.300 | 1.872 | 0,02 |
| **Nationwide Building Society** | | | |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | $ 35.400 | 36.975 | 0,43 |
| **RAC Bond Co. PLC** | | | |
| 4,565 % fällig am 06.05.2046 | £ 1.000 | 1.268 | 0,01 |
| 4,870 % fällig am 06.05.2046 | 7.982 | 9.995 | 0,12 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | |
| 1,750 % fällig am 02.03.2026 | € 6.600 | 7.708 | 0,09 |
| 2,000 % fällig am 08.03.2023 | 8.900 | 10.472 | 0,12 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | 500 | 592 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | 20.218 | 24.471 | 0,28 |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | $ 1.200 | 1.198 | 0,01 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | 41.075 | 43.972 | 0,51 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | 3.200 | 3.420 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (h)(j) | 7.500 | 7.706 | 0,09 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (h)(j) | 7.600 | 8.210 | 0,10 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (h)(j) | £ 25.735 | 34.278 | 0,40 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | |
| 3,474 % fällig am 28.12.2031 | 400 | 505 | 0,01 |
| **Tesco PLC** | | | |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | 139 | 198 | 0,00 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | 22.530 | 36.641 | 0,42 |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | 98 | 162 | 0,00 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | 2.712 | 4.514 | 0,05 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | 683 | 1.151 | 0,01 |
| **TP ICAP PLC** | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | 4.700 | 6.260 | 0,07 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | 5.282 | 6.886 | 0,08 |
| **Travis Perkins PLC** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2021 | 2.584 | 3.408 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 07.09.2023 | 15.305 | 20.109 | 0,23 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | 8.813 | 12.608 | 0,15 |
| 7,395 % fällig am 28.03.2024 | 1.700 | 2.444 | 0,03 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | 34.200 | 44.926 | 0,52 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | 13.700 | 18.023 | 0,21 |
| 5,125 % fällig am 15.01.2025 | 1.000 | 1.323 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.05.2029 | $ 6.900 | 7.019 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 28.03.2029 | £ 300 | 405 | 0,00 |
| **Virgin Money Holdings UK PLC** | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2026 | 100 | 128 | 0,00 |
| | | 602.770 | 6,98 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Canary Wharf Finance PLC** | | | |
| 6,800 % fällig am 22.10.2033 | 59 | 98 | 0,00 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | |
| 1,732 % fällig am 20.12.2046 | 872 | 1.112 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | 25.200 | 32.194 | 0,37 |
| | | 33.404 | 0,38 |
| Summe Großbritannien | | 636.174 | 7,36 |
| **USA** | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,534 % fällig am 25.02.2037 | $ 128 | 129 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.04.2036 | 2.324 | 2.290 | 0,03 |
| 2,724 % fällig am 25.12.2035 | 171 | 171 | 0,00 |
| 2,945 % fällig am 25.09.2035 | 882 | 864 | 0,01 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.04.2036 | 664 | 656 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 ^ | 12.538 | 4.608 | 0,05 |
| 2,559 % fällig am 25.08.2036 | 1.164 | 1.141 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.08.2036 ^ | 2.611 | 855 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.02.2036 | 2.506 | 2.504 | 0,03 |
| 3,024 % fällig am 25.02.2036 ^ | 138 | 132 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.11.2035 | 1.038 | 1.045 | 0,01 |
| 3,199 % fällig am 25.01.2035 | 845 | 847 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.12.2034 | 1.583 | 1.571 | 0,02 |
| 3,379 % fällig am 25.06.2034 | 661 | 670 | 0,01 |

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

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,834 % fällig am 25.12.2035 | $ 200 | $ 197 | 0,00 |
| 2,844 % fällig am 25.06.2035 | 163 | 162 | 0,00 |
| 3,404 % fällig am 25.03.2035 ^ | 530 | 517 | 0,01 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,854 % fällig am 25.10.2035 | 314 | 317 | 0,00 |
| **Aircraft Certificate Owner Trust** | | | |
| 7,001 % fällig am 20.09.2022 | 547 | 564 | 0,01 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,794 % fällig am 25.03.2036 | 90 | 90 | 0,00 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,854 % fällig am 25.01.2036 | 756 | 759 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.09.2035 | 2.951 | 2.968 | 0,04 |
| 3,094 % fällig am 25.07.2035 | 327 | 328 | 0,00 |
| 3,274 % fällig am 25.07.2034 | 454 | 457 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.05.2035 | 1.000 | 1.006 | 0,01 |
| 3,424 % fällig am 25.10.2034 | 300 | 303 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.11.2034 | 385 | 388 | 0,01 |
| 3,514 % fällig am 25.03.2035 | 200 | 202 | 0,00 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | |
| 3,404 % fällig am 25.10.2034 | 183 | 184 | 0,00 |
| **Argent Securities Trust** | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2036 | 927 | 360 | 0,01 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | |
| 2,514 % fällig am 25.01.2037 | 258 | 168 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | 895 | 588 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.01.2037 | 298 | 198 | 0,00 |
| 3,079 % fällig am 25.06.2035 | 153 | 153 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.03.2034 ^ | 536 | 504 | 0,01 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,854 % fällig am 25.11.2035 | 596 | 600 | 0,01 |
| 3,364 % fällig am 25.07.2035 | 1.000 | 1.005 | 0,01 |
| 3,639 % fällig am 15.08.2033 | 812 | 818 | 0,01 |
| **Basic Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,714 % fällig am 25.04.2036 | 119 | 120 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,514 % fällig am 25.04.2031 | 55 | 81 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.10.2036 | 363 | 364 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.05.2037 | 48 | 48 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.10.2036 | 206 | 206 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.06.2036 | 300 | 300 | 0,00 |
| 2,690 % fällig am 25.12.2036 | 945 | 946 | 0,01 |
| 2,724 % fällig am 25.01.2047 | 113 | 113 | 0,00 |
| 2,834 % fällig am 25.12.2035 | 500 | 502 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.12.2035 | 124 | 124 | 0,00 |
| 2,954 % fällig am 25.06.2036 | 300 | 299 | 0,00 |
| 3,104 % fällig am 25.11.2035 ^ | 54 | 50 | 0,00 |
| 3,364 % fällig am 25.04.2035 | 82 | 83 | 0,00 |
| 3,404 % fällig am 25.10.2037 | 218 | 219 | 0,00 |
| 3,409 % fällig am 25.06.2035 | 941 | 944 | 0,01 |
| 3,604 % fällig am 25.01.2045 | 346 | 348 | 0,01 |
| 3,654 % fällig am 25.08.2037 | 321 | 323 | 0,00 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,464 % fällig am 25.01.2037 | 158 | 152 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.10.2036 | 1.087 | 853 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.01.2037 | 1.200 | 966 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.06.2036 | 2.338 | 2.244 | 0,03 |
| 2,654 % fällig am 25.10.2036 | 1.087 | 862 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.02.2037 | 3.100 | 2.923 | 0,03 |
| 2,864 % fällig am 25.06.2035 | 467 | 468 | 0,01 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,864 % fällig am 25.10.2035 | 19 | 19 | 0,00 |
| **Chase Funding Trust** | | | |
| 6,333 % fällig am 25.04.2032 | 554 | 567 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.12.2036 | 330 | 329 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2036 | 933 | 702 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.05.2037 | 269 | 268 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.05.2037 | 1.217 | 906 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.12.2036 | 1.600 | 1.555 | 0,02 |
| 2,804 % fällig am 25.11.2046 | 238 | 235 | 0,00 |
| 2,854 % fällig am 25.11.2045 | 194 | 193 | 0,00 |
| 3,024 % fällig am 25.12.2035 | 98 | 98 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 2,664 % fällig am 25.01.2037 | 300 | 299 | 0,00 |
| 3,139 % fällig am 25.09.2035 ^ | 500 | 505 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.07.2037 ^ | $ 3.002 | $ 2.672 | 0,03 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 ^ | 65 | 65 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | 176 | 176 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.05.2037 | 1.080 | 1.073 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2047 ^ | 532 | 530 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2034 | 1.048 | 1.044 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.12.2035 ^ | 339 | 336 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.05.2036 | 412 | 381 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.03.2037 | 187 | 177 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.05.2037 | 24 | 24 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.06.2047 | 52 | 52 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.06.2047 | 106 | 106 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.06.2037 | 2.000 | 1.954 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2037 ^ | 184 | 154 | 0,00 |
| 2,634 % fällig am 25.10.2047 | 395 | 382 | 0,01 |
| 2,694 % fällig am 25.07.2036 | 887 | 877 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.07.2036 | 150 | 150 | 0,00 |
| 2,714 % fällig am 25.09.2037 ^ | 660 | 482 | 0,01 |
| 2,724 % fällig am 25.02.2037 ^ | 5.500 | 4.689 | 0,06 |
| 2,754 % fällig am 25.03.2036 ^ | 1.820 | 1.674 | 0,02 |
| 2,754 % fällig am 25.04.2036 | 32 | 32 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.06.2036 | 400 | 397 | 0,01 |
| 2,854 % fällig am 25.03.2047 ^ | 88 | 67 | 0,00 |
| 2,954 % fällig am 25.05.2047 ^ | 1.561 | 1.248 | 0,02 |
| 2,964 % fällig am 25.04.2034 | 16 | 15 | 0,00 |
| 2,964 % fällig am 25.12.2035 | 121 | 122 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.12.2035 | 400 | 404 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 25.02.2036 | 5 | 5 | 0,00 |
| 3,154 % fällig am 25.03.2034 | 119 | 120 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.08.2035 | 91 | 92 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.02.2035 | 300 | 307 | 0,00 |
| 4,009 % fällig am 25.01.2034 ^ | 10 | 10 | 0,00 |
| 4,651 % fällig am 25.10.2046 ^ | 985 | 972 | 0,01 |
| 4,763 % fällig am 25.07.2036 | 1.700 | 1.763 | 0,02 |
| 4,763 % fällig am 25.07.2036 | 284 | 291 | 0,00 |
| 4,804 % fällig am 25.01.2034 ^ | 831 | 697 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.03.2047 ^ | 164 | 161 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.03.2037 | 127 | 126 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.06.2047 | 167 | 166 | 0,00 |
| 2,854 % fällig am 25.04.2036 | 100 | 100 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.05.2036 | 1.100 | 1.088 | 0,01 |
| 2,934 % fällig am 25.02.2036 | 300 | 300 | 0,00 |
| 2,984 % fällig am 25.11.2035 | 29 | 29 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.02.2036 ^ | 11.608 | 10.624 | 0,12 |
| 3,124 % fällig am 25.07.2034 | 132 | 132 | 0,00 |
| 3,134 % fällig am 25.07.2035 | 400 | 403 | 0,01 |
| 3,204 % fällig am 25.08.2047 | 500 | 500 | 0,01 |
| 3,244 % fällig am 25.10.2047 | 9.808 | 9.819 | 0,11 |
| 3,259 % fällig am 25.08.2034 | 195 | 194 | 0,00 |
| 3,979 % fällig am 25.11.2034 | 1.200 | 1.165 | 0,01 |
| 4,740 % fällig am 25.10.2035 | 27 | 28 | 0,00 |
| 5,210 % fällig am 25.03.2034 | 1.683 | 1.708 | 0,02 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 3,024 % fällig am 25.01.2032 | 46 | 46 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.07.2037 | 276 | 188 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 2,654 % fällig am 25.07.2036 | 2.000 | 1.946 | 0,02 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | |
| 3,454 % fällig am 25.05.2037 | 2.996 | 3.006 | 0,04 |
| **EMC Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,304 % fällig am 25.05.2043 | 31 | 31 | 0,00 |
| 3,504 % fällig am 25.11.2041 | 3 | 3 | 0,00 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 0,000 % fällig am 25.04.2036 (b)(f) | 1.310 | 1.181 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | 238 | 237 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.04.2036 | 205 | 200 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.04.2036 | 400 | 377 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2036 | 364 | 333 | 0,00 |
| 2,764 % fällig am 25.10.2035 | 828 | 828 | 0,01 |
| 2,854 % fällig am 25.06.2036 | 140 | 141 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 25.07.2035 | 408 | 409 | 0,01 |
| 2,884 % fällig am 25.12.2035 | 630 | 634 | 0,01 |
| 3,199 % fällig am 25.09.2035 | 865 | 870 | 0,01 |
| 3,214 % fällig am 25.04.2035 | 69 | 69 | 0,00 |
| 3,289 % fällig am 25.03.2035 | 557 | 561 | 0,01 |
| 3,349 % fällig am 25.03.2035 | 100 | 100 | 0,00 |
| 3,604 % fällig am 25.01.2035 | 122 | 123 | 0,00 |
| 3,829 % fällig am 25.10.2034 | 450 | 449 | 0,01 |
| **First NLC Trust** | | | |
| 1,029 % fällig am 25.05.2035 | $ 242 | $ 238 | 0,00 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.02.2036 | 3.505 | 3.351 | 0,04 |
| 2,574 % fällig am 25.02.2037 | 1.412 | 727 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.06.2035 ^ | 3.077 | 2.925 | 0,03 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | |
| 2,464 % fällig am 25.11.2036 | 532 | 229 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.04.2047 | 211 | 201 | 0,00 |
| 2,854 % fällig am 25.08.2037 | 276 | 270 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 2,454 % fällig am 25.12.2046 | 319 | 199 | 0,00 |
| 2,494 % fällig am 25.01.2037 | 381 | 261 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | 144 | 143 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.12.2035 | 62 | 62 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.04.2036 | 2.126 | 1.615 | 0,02 |
| 2,794 % fällig am 25.01.2036 | 1.000 | 1.000 | 0,01 |
| 3,274 % fällig am 25.11.2034 | 744 | 746 | 0,01 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | |
| 3,499 % fällig am 25.07.2035 | 2.000 | 2.023 | 0,02 |
| **Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,744 % fällig am 25.04.2037 | 2.000 | 1.701 | 0,02 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.11.2036 | 518 | 496 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.06.2036 | 451 | 445 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.04.2037 | 1.096 | 839 | 0,01 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | |
| 2,514 % fällig am 25.12.2036 | 585 | 237 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.01.2037 | 4.297 | 3.472 | 0,04 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | |
| 3,334 % fällig am 25.09.2035 | 92 | 94 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | |
| 2,694 % fällig am 25.05.2035 | 565 | 566 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.01.2036 | 70 | 69 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.06.2036 | 143 | 143 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | 15 | 15 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.04.2036 | 137 | 137 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.03.2047 | 3.439 | 3.378 | 0,04 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2036 | 100 | 99 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.03.2037 | 300 | 298 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.06.2037 | 1.000 | 987 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.05.2036 | 385 | 382 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.07.2036 | 200 | 194 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.01.2037 | 300 | 294 | 0,00 |
| 4,686 % fällig am 25.01.2037^ | 753 | 548 | 0,01 |
| 4,909 % fällig am 25.11.2036 | 307 | 314 | 0,00 |
| **Lehman ABS Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,494 % fällig am 25.06.2037 | 383 | 280 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.06.2037 | 196 | 146 | 0,00 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 3,204 % fällig am 25.10.2035 | 337 | 336 | 0,00 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2046 | 2.929 | 1.391 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.02.2036 | 16.640 | 14.537 | 0,17 |
| 3,049 % fällig am 25.11.2035 | 316 | 315 | 0,00 |
| 3,139 % fällig am 25.08.2035 | 314 | 316 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.06.2035 | 1.034 | 1.040 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.04.2035 | 644 | 649 | 0,01 |
| 3,454 % fällig am 25.06.2035 | 400 | 401 | 0,01 |
| 3,679 % fällig am 25.02.2035 | 200 | 202 | 0,00 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,504 % fällig am 25.08.2036 | 5.833 | 2.457 | 0,03 |
| 2,514 % fällig am 25.08.2036 | 2.435 | 1.275 | 0,02 |
| 2,554 % fällig am 25.03.2036 | 1.635 | 1.423 | 0,02 |
| 2,574 % fällig am 25.10.2036 | 277 | 274 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.02.2036 | 436 | 229 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.03.2036 | 1.550 | 1.137 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.10.2035 ^ | 442 | 423 | 0,01 |
| 3,094 % fällig am 25.03.2035 | 164 | 165 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.04.2034 | 616 | 613 | 0,01 |
| **MASTR Specialized Loan Trust** | | | |
| 3,154 % fällig am 25.11.2035 | 200 | 198 | 0,00 |
| **Meritage Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,154 % fällig am 25.11.2035 | 69 | 71 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.08.2037 | 3.770 | 2.442 | 0,03 |
| 2,574 % fällig am 25.07.2037 | 1.448 | 812 | 0,01 |
| 2,714 % fällig am 25.08.2036 | 225 | 226 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| 2,854 % fällig am 25.02.2047 | $ 148 | $ 108 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.05.2036 | 223 | 221 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.04.2035 | 353 | 359 | 0,01 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,474 % fällig am 25.10.2036 | 87 | 54 | 0,00 |
| 2,504 % fällig am 25.09.2036 | 4 | 2 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.10.2036 | 1.205 | 745 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.11.2036 | 254 | 159 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.10.2036 | 231 | 146 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.11.2036 | 4.143 | 2.986 | 0,04 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2036 | 1.504 | 848 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.11.2036 | 317 | 200 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.03.2037 | 1.180 | 652 | 0,01 |
| 2,714 % fällig am 25.12.2035 | 342 | 341 | 0,01 |
| 2,984 % fällig am 25.01.2035 | 560 | 560 | 0,01 |
| 3,049 % fällig am 25.09.2035 | 342 | 343 | 0,01 |
| 3,109 % fällig am 25.12.2034 | 132 | 126 | 0,00 |
| 3,109 % fällig am 25.01.2035 | 1.380 | 1.383 | 0,02 |
| 3,259 % fällig am 25.03.2034 | 1.012 | 998 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.03.2035 | 166 | 167 | 0,00 |
| 3,394 % fällig am 25.06.2035 | 2.730 | 2.740 | 0,03 |
| 3,654 % fällig am 25.07.2037 | 400 | 381 | 0,01 |
| 4,330 % fällig am 25.02.2047 | 1.246 | 1.156 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust** | | | |
| 3,304 % fällig am 25.07.2032 | 59 | 59 | 0,00 |
| 3,754 % fällig am 25.02.2033 | 491 | 494 | 0,01 |
| 3,979 % fällig am 25.11.2032 | 675 | 679 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,504 % fällig am 25.12.2036 | 1.890 | 1.103 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.04.2036 | 101 | 81 | 0,00 |
| 2,634 % fällig am 25.04.2037 | 426 | 290 | 0,00 |
| 2,754 % fällig am 25.04.2037 | 213 | 147 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,794 % fällig am 25.11.2036 ^ | 270 | 133 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 101 | 80 | 0,00 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.05.2036 | 21 | 20 | 0,00 |
| 2,914 % fällig am 25.09.2035 | 794 | 796 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 25.03.2035 | 167 | 165 | 0,00 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,814 % fällig am 25.02.2036 | 124 | 125 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,504 % fällig am 25.01.2037 | 1.227 | 569 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.03.2037 | 1.372 | 673 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2037 | 4.898 | 4.834 | 0,06 |
| 2,614 % fällig am 25.01.2037 | 1.464 | 691 | 0,01 |
| 3,079 % fällig am 25.01.2036 | 74 | 74 | 0,00 |
| 4,305 % fällig am 25.03.2035 | 1.000 | 1.006 | 0,01 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 | 212 | 140 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.05.2037 | 178 | 110 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.04.2037 | 590 | 391 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.07.2037 | 3.136 | 2.305 | 0,03 |
| 2,764 % fällig am 25.01.2036 | 400 | 369 | 0,01 |
| 3,169 % fällig am 25.08.2035 | 400 | 393 | 0,01 |
| **Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates** | | | |
| 2,864 % fällig am 25.11.2035 | 700 | 685 | 0,01 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,004 % fällig am 25.10.2036 ^ | 212 | 191 | 0,00 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | |
| 2,894 % fällig am 25.09.2035 | 200 | 194 | 0,00 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,874 % fällig am 25.09.2035 | 386 | 388 | 0,01 |
| 2,894 % fällig am 25.08.2035 | 410 | 404 | 0,01 |
| 2,894 % fällig am 25.09.2035 | 600 | 600 | 0,01 |
| 3,154 % fällig am 25.07.2035 | 568 | 571 | 0,01 |
| 3,199 % fällig am 25.07.2035 | 400 | 403 | 0,01 |
| 3,229 % fällig am 25.07.2035 | 400 | 389 | 0,01 |
| 3,244 % fällig am 25.01.2036 | 31 | 31 | 0,00 |
| 3,349 % fällig am 25.06.2035 | 200 | 201 | 0,00 |
| 3,394 % fällig am 25.09.2034 | 493 | 495 | 0,01 |
| 3,454 % fällig am 25.10.2034 | 500 | 509 | 0,01 |
| 3,484 % fällig am 25.03.2035 | 818 | 821 | 0,01 |
| 3,529 % fällig am 25.03.2035 | 400 | 401 | 0,01 |
| 3,649 % fällig am 25.01.2036 | 300 | 302 | 0,00 |
| 4,204 % fällig am 25.12.2034 | 406 | 423 | 0,01 |
| **People's Choice Home Loan Securities Trust** | | | |
| 3,124 % fällig am 25.05.2035 ^ | $ 82 | $ 81 | 0,00 |
| 3,754 % fällig am 25.01.2035 | 1.486 | 1.463 | 0,02 |
| **People's Financial Realty Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.09.2036 | 1.145 | 445 | 0,01 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,614 % fällig am 25.01.2037 | 1.000 | 971 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.11.2036 | 173 | 171 | 0,00 |
| 2,794 % fällig am 25.02.2036 | 366 | 365 | 0,01 |
| **RAAC Trust** | | | |
| 2,704 % fällig am 25.06.2044 | 119 | 109 | 0,00 |
| 2,744 % fällig am 25.08.2036 | 475 | 481 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.11.2046 | 292 | 281 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.09.2045 | 252 | 252 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.06.2047 | 48 | 48 | 0,00 |
| 2,884 % fällig am 25.03.2037 | 166 | 167 | 0,00 |
| 3,604 % fällig am 25.10.2045 | 250 | 253 | 0,00 |
| 3,604 % fällig am 25.09.2047 | 520 | 525 | 0,01 |
| 3,904 % fällig am 25.09.2047 | 500 | 521 | 0,01 |
| 4,154 % fällig am 25.06.2035 | 273 | 275 | 0,00 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.02.2037 | 127 | 127 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2034 | 6 | 6 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.01.2036 | 770 | 703 | 0,01 |
| 3,064 % fällig am 25.10.2035 | 128 | 129 | 0,00 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 2,534 % fällig am 25.11.2036 | 561 | 478 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.06.2036 | 31 | 31 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.11.2036 ^ | 869 | 838 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.11.2036 | 152 | 133 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.09.2036 | 524 | 522 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.04.2037 | 1.887 | 1.877 | 0,02 |
| 2,674 % fällig am 25.04.2036 | 216 | 217 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.04.2036 | 100 | 98 | 0,00 |
| 2,784 % fällig am 25.02.2036 | 229 | 230 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.12.2035 | 1.025 | 1.029 | 0,01 |
| 2,804 % fällig am 25.02.2036 | 300 | 290 | 0,00 |
| 2,814 % fällig am 25.11.2035 | 94 | 94 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.12.2035 | 400 | 401 | 0,01 |
| 2,844 % fällig am 25.11.2035 | 300 | 301 | 0,00 |
| 2,844 % fällig am 25.01.2036 | 1.436 | 1.442 | 0,02 |
| 2,864 % fällig am 25.09.2035 | 259 | 260 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.12.2035 | 309 | 260 | 0,00 |
| 3,079 % fällig am 25.02.2035 | 491 | 494 | 0,01 |
| 3,169 % fällig am 25.03.2034 | 81 | 81 | 0,00 |
| 3,199 % fällig am 25.01.2035 | 88 | 88 | 0,00 |
| 3,229 % fällig am 25.07.2034 | 892 | 889 | 0,01 |
| 3,244 % fällig am 25.12.2034 | 28 | 28 | 0,00 |
| 3,274 % fällig am 25.05.2035 | 291 | 292 | 0,00 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | |
| 2,869 % fällig am 25.03.2036 | 3.600 | 3.337 | 0,04 |
| 3,304 % fällig am 25.08.2032 | 36 | 35 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.06.2033 | 564 | 567 | 0,01 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 2,494 % fällig am 25.07.2036 | 313 | 160 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.07.2036 | 1.202 | 993 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.03.2036 | 1.571 | 1.138 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.05.2036 | 341 | 223 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.03.2036 | 196 | 184 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.08.2035 ^ | 210 | 143 | 0,00 |
| 3,379 % fällig am 25.03.2035 | 182 | 183 | 0,00 |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | |
| 4,644 % fällig am 16.06.2042 | 1.100 | 1.113 | 0,01 |
| 4,894 % fällig am 15.01.2043 | 123 | 124 | 0,00 |
| 5,450 % fällig am 16.05.2044 | 45 | 45 | 0,00 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | |
| 1,339 % fällig am 15.03.2038 | £ 4.746 | 5.817 | 0,07 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 2,464 % fällig am 25.11.2036 | $ 40 | 17 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.11.2036 | 46 | 46 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.07.2036 | 200 | 188 | 0,00 |
| 2,714 % fällig am 25.06.2036 ^ | 24.187 | 17.523 | 0,20 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.11.2037 | 903 | 659 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.04.2037 | 229 | 144 | 0,00 |
| 3,229 % fällig am 25.05.2035 | 334 | 335 | 0,00 |
| 4,268 % fällig am 25.02.2037 ^ | 623 | 348 | 0,00 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | 73 | 71 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | 530 | 512 | 0,01 |
| 3,004 % fällig am 25.01.2036 | $ 313 | $ 314 | 0,00 |
| 3,094 % fällig am 25.06.2035 | 220 | 221 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.02.2035 | 435 | 438 | 0,01 |
| 3,169 % fällig am 25.08.2035 | 7.200 | 7.172 | 0,08 |
| 3,304 % fällig am 25.09.2034 | 154 | 153 | 0,00 |
| 3,379 % fällig am 25.10.2033 | 532 | 534 | 0,01 |
| 3,529 % fällig am 25.07.2033 | 58 | 58 | 0,00 |
| 3,784 % fällig am 25.04.2033 | 11 | 11 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 | 684 | 671 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.02.2037 | 349 | 346 | 0,00 |
| 2,634 % fällig am 25.01.2037 | 2.842 | 2.046 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.09.2036 | 300 | 297 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.08.2037 | 198 | 200 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 2,864 % fällig am 25.09.2035 | 300 | 291 | 0,00 |
| **Truman Capital Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,664 % fällig am 25.03.2036 | 1.887 | 1.868 | 0,02 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | 1.547 | 1.291 | 0,02 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 2,644 % fällig am 25.05.2036 | 1.051 | 913 | 0,01 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,664 % fällig am 25.05.2036 | 347 | 348 | 0,00 |
| 2,734 % fällig am 25.05.2036 | 300 | 299 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.12.2035 | 101 | 101 | 0,00 |
| 3,274 % fällig am 25.03.2035 | 70 | 70 | 0,00 |
| 3,979 % fällig am 25.02.2035 | 200 | 201 | 0,00 |
| **Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,774 % fällig am 25.04.2034 | 445 | 448 | 0,01 |
| | | 278.756 | 3,22 |

## UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Alliance Data Systems Corp.** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.11.2021 | 15.590 | 16.058 | 0,19 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | 18.915 | 18.965 | 0,22 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | 4.030 | 4.079 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 15.04.2021 | 2.374 | 2.427 | 0,03 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | 11.860 | 15.716 | 0,18 |
| **Ambac Assurance Corp.** | | | |
| 5,100 % fällig am 07.06.2020 | 14 | 20 | 0,00 |
| **Amgen, Inc.** | | | |
| 4,663 % fällig am 15.06.2051 | 895 | 979 | 0,01 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | 200 | 205 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2027 | 500 | 529 | 0,01 |
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 4,550 % fällig am 09.03.2049 | 836 | 855 | 0,01 |
| 4,900 % fällig am 15.08.2037 | 8.300 | 8.960 | 0,10 |
| 5,300 % fällig am 15.08.2058 | 39.522 | 44.083 | 0,51 |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 3,269 % fällig am 05.03.2024 | 1.200 | 1.202 | 0,01 |
| 4,100 % fällig am 24.07.2023 | 500 | 534 | 0,01 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | |
| 5,375 % fällig am 24.07.2023 | 100 | 105 | 0,00 |
| **Broadcom Corp.** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.01.2022 | 300 | 301 | 0,00 |
| **Campbell Soup Co.** | | | |
| 3,650 % fällig am 15.03.2023 | 500 | 515 | 0,01 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | |
| 6,500 % fällig am 17.06.2022 | 2.100 | 2.260 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | 26.930 | 27.279 | 0,32 |
| **Catalent Pharma Solutions, Inc.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2027 | 200 | 204 | 0,00 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | 4.700 | 4.887 | 0,06 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | 26.433 | 27.785 | 0,32 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 (c) | 16.600 | 17.016 | 0,20 |
| 5,375 % fällig am 01.04.2038 | 500 | 536 | 0,01 |
| **Cheniere Corpus Christi Holdings LLC** | | | |
| 5,125 % fällig am 30.06.2027 | 7.600 | 8.274 | 0,10 |
| **CIT Group, Inc.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | 2.976 | 3.165 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2023 | 2.320 | 2.485 | 0,03 |
| **Citigroup, Inc.** | | | |
| 3,400 % fällig am 01.05.2026 | 3.900 | 4.040 | 0,05 |

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

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Cogent Communications Group, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 30.06.2024 | € | 4.400 | $ 5.039 | 0,06 |
| **CommScope Technologies LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | $ | 1.000 | 875 | 0,01 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.01.2028 | | 12.300 | 12.956 | 0,15 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 09.03.2023 | | 11.000 | 11.383 | 0,13 |
| **CyrusOne LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2024 | | 100 | 103 | 0,00 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2020 | | 20.570 | 20.621 | 0,24 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2022 | | 100 | 102 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | | 4.700 | 4.906 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 15.11.2023 | | 100 | 105 | 0,00 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 5,300 % fällig am 01.10.2029 | | 16.400 | 17.297 | 0,20 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 9.800 | 10.569 | 0,12 |
| 6,020 % fällig am 15.06.2026 | | 3.000 | 3.312 | 0,04 |
| 8,100 % fällig am 15.07.2036 | | 2.800 | 3.457 | 0,04 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | € | 3.200 | 3.981 | 0,05 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | $ | 994 | 1.001 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | | 3.900 | 3.705 | 0,04 |
| 6,750 % fällig am 01.06.2021 | | 22.700 | 23.863 | 0,28 |
| 7,750 % fällig am 01.07.2026 | | 15.300 | 14.879 | 0,17 |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 1.850 | 1.862 | 0,02 |
| **Doctors Co.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.10.2023 | | 10.100 | 10.902 | 0,13 |
| **El Paso Natural Gas Co. LLC** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.06.2032 | | 1.000 | 1.345 | 0,02 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 500 | 497 | 0,01 |
| **Enable Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.05.2028 | | 100 | 105 | 0,00 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.02.2023 | | 2.125 | 2.173 | 0,03 |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | | 500 | 509 | 0,01 |
| 4,200 % fällig am 15.09.2023 | | 100 | 105 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 15.04.2029 | | 100 | 112 | 0,00 |
| 6,050 % fällig am 01.06.2041 | | 600 | 673 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 15.12.2045 | | 800 | 908 | 0,01 |
| 6,625 % fällig am 15.10.2036 | | 400 | 466 | 0,01 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.11.2023 | | 5.435 | 5.745 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2022 | | 22.200 | 23.607 | 0,27 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2022 | | 16.800 | 18.027 | 0,21 |
| **EQT Corp.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.10.2027 | | 200 | 190 | 0,00 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.03.2024 | € | 11.800 | 14.080 | 0,16 |
| **Fidelity National Financial, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2022 | $ | 2.200 | 2.382 | 0,03 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.10.2022 | | 4.585 | 4.867 | 0,06 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.11.2031 | | 12.080 | 16.528 | 0,19 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | € | 9.600 | 10.708 | 0,12 |
| 0,100 % fällig am 07.12.2022 | | 1.400 | 1.532 | 0,02 |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | | 4.000 | 4.506 | 0,05 |
| 1,514 % fällig am 17.02.2023 | | 400 | 459 | 0,01 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | | 6.900 | 8.333 | 0,10 |
| 3,096 % fällig am 04.05.2023 | $ | 200 | 197 | 0,00 |
| 3,336 % fällig am 18.03.2021 | | 2.900 | 2.916 | 0,03 |
| 3,408 % fällig am 05.04.2021 | | 1.500 | 1.481 | 0,02 |
| 3,484 % fällig am 12.10.2021 | | 2.260 | 2.225 | 0,03 |
| 3,656 % fällig am 03.08.2022 | | 300 | 294 | 0,00 |
| 3,753 % fällig am 15.02.2023 | | 1.600 | 1.554 | 0,02 |
| 4,250 % fällig am 20.09.2022 | | 400 | 410 | 0,01 |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 | | 200 | 204 | 0,00 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 7.500 | 8.056 | 0,09 |
| 5,596 % fällig am 07.01.2022 | | 10.600 | 11.225 | 0,13 |
| 5,729 % fällig am 07.01.2022 | | 700 | 722 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 02.08.2021 | | 200 | 211 | 0,00 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.03.2022 | | 7.700 | 8.018 | 0,09 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.11.2024 | $ | 5.970 | $ 5.104 | 0,06 |
| 8,250 % fällig am 15.04.2025 | | 11.053 | 9.561 | 0,11 |
| 10,750 % fällig am 01.04.2024 | | 4.600 | 4.301 | 0,05 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 17.05.2022 | € | 100 | 115 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 17.05.2029 | | 2.100 | 2.365 | 0,03 |
| 3,100 % fällig am 09.01.2023 | $ | 100 | 101 | 0,00 |
| 3,450 % fällig am 15.05.2024 | | 100 | 102 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 11.03.2044 | | 500 | 486 | 0,01 |
| 5,550 % fällig am 04.05.2020 | | 400 | 409 | 0,01 |
| 5,550 % fällig am 05.01.2026 | | 5.700 | 6.371 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 14.01.2038 | | 300 | 339 | 0,00 |
| 6,150 % fällig am 07.08.2037 | | 100 | 116 | 0,00 |
| 6,875 % fällig am 10.01.2039 | | 100 | 126 | 0,00 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 10.04.2022 | | 1.700 | 1.725 | 0,02 |
| 5,100 % fällig am 17.01.2024 | | 800 | 856 | 0,01 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.06.2028 | | 2.600 | 2.875 | 0,03 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 2,876 % fällig am 31.10.2022 | | 800 | 807 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 6.500 | 6.804 | 0,08 |
| **Greif, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.03.2027 | | 2.700 | 2.794 | 0,03 |
| **Hartford HealthCare Corp.** | | | | |
| 5,746 % fällig am 01.04.2044 | | 2.400 | 2.921 | 0,03 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.02.2027 | | 2.100 | 2.244 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 01.05.2023 | | 18.800 | 20.141 | 0,23 |
| 5,375 % fällig am 01.09.2026 | | 1.000 | 1.080 | 0,01 |
| 5,625 % fällig am 01.09.2028 | | 5.650 | 6.130 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 01.02.2029 | | 100 | 110 | 0,00 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2030 | | 1.200 | 1.239 | 0,01 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.04.2027 | | 1.200 | 1.245 | 0,01 |
| **Hospitality Properties Trust** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 300 | 315 | 0,00 |
| **Howard Hughes Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.03.2025 | | 1.800 | 1.869 | 0,02 |
| **Ingram Micro, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 10.08.2022 | | 2.900 | 2.929 | 0,03 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.04.2021 | | 300 | 310 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 15.08.2022 | | 32.200 | 35.089 | 0,41 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 7.400 | 7.986 | 0,09 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2022 | | 5.400 | 6.161 | 0,07 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.03.2025 | € | 3.500 | 4.120 | 0,05 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 03.06.2026 | | $11.700 | 11.832 | 0,14 |
| 7,250 % fällig am 15.08.2024 | | 3.700 | 3.653 | 0,04 |
| **Jefferies Group LLC** | | | | |
| 4,150 % fällig am 23.01.2030 | | 2.700 | 2.591 | 0,03 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.03.2041 | | 3.710 | 4.489 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 01.02.2037 | | 2.000 | 2.405 | 0,03 |
| 6,950 % fällig am 15.01.2038 | | 9.890 | 12.697 | 0,15 |
| 7,500 % fällig am 15.11.2040 | | 3.600 | 4.823 | 0,06 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 5,300 % fällig am 01.12.2034 | | 700 | 792 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 15.01.2032 | | 6.609 | 9.055 | 0,11 |
| 7,800 % fällig am 01.08.2031 | | 8.225 | 11.069 | 0,13 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.07.2027 | £ | 600 | 834 | 0,01 |
| **L Brands, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.11.2035 | $ | 700 | 626 | 0,01 |
| **Marriott Ownership Resorts, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.09.2026 | | 1.100 | 1.185 | 0,01 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.12.2021 | | 1.200 | 1.299 | 0,02 |
| 7,750 % fällig am 15.03.2022 | | 500 | 559 | 0,01 |
| **Midcontinent Express Pipeline LLC** | | | | |
| 6,700 % fällig am 15.09.2019 | | 24.071 | 24.303 | 0,28 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 3,875 % fällig am 27.01.2026 | | 200 | 213 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 23.07.2025 | | 5.000 | 5.360 | 0,06 |
| **National Fuel Gas Co.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 15.07.2025 | $ | 2.910 | $ 3.148 | 0,04 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 26.07.2021 | | 400 | 424 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 25.01.2022 | | 5.700 | 6.170 | 0,07 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | € | 31.600 | 39.072 | 0,45 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | $ | 2.000 | 2.129 | 0,02 |
| **NextEra Energy Operating Partners LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.07.2024 | | 3.500 | 3.529 | 0,04 |
| **NGPL PipeCo LLC** | | | | |
| 7,768 % fällig am 15.12.2037 | | 1.000 | 1.275 | 0,02 |
| **Northwest Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 7,150 % fällig am 01.04.2021 | | 64 | 63 | 0,00 |
| **Oxford Finance LLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.12.2022 | | 1.600 | 1.648 | 0,02 |
| **Pitney Bowes, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.09.2020 | | 400 | 401 | 0,00 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.11.2024 | | 300 | 304 | 0,00 |
| 3,850 % fällig am 15.10.2023 | | 100 | 103 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.12.2026 | | 800 | 852 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2020 | | 200 | 203 | 0,00 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.12.2029 (c) | | 1.100 | 1.107 | 0,01 |
| **QEP Resources, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.03.2026 | | 6.600 | 6.237 | 0,07 |
| **Quicken Loans, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | | 27.500 | 27.466 | 0,32 |
| **QVC, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2023 | | 9.723 | 9.876 | 0,11 |
| 5,450 % fällig am 15.08.2034 | | 8.000 | 7.891 | 0,09 |
| **Reliance Steel & Aluminum Co.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2023 | | 1.000 | 1.051 | 0,01 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 27.328 | 30.574 | 0,35 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 2.604 | 3.001 | 0,04 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2020 | | 48.700 | 49.735 | 0,58 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | | 4.900 | 5.377 | 0,06 |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 12.000 | 12.468 | 0,14 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 1.300 | 1.417 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | | 54.725 | 61.334 | 0,71 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 11.965 | 13.314 | 0,15 |
| 5,875 % fällig am 30.06.2026 | | 7.900 | 9.034 | 0,10 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 7.300 | 7.866 | 0,09 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | | 13.400 | 14.706 | 0,17 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2026 | | 13.600 | 14.926 | 0,17 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 400 | 426 | 0,01 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 5,152 % fällig am 20.09.2029 | | 11.800 | 12.183 | 0,14 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 8.050 | 8.010 | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2023 | | 500 | 515 | 0,01 |
| **Sunoco Logistics Partners Operations LP** | | | | |
| 6,100 % fällig am 15.02.2042 | | 800 | 887 | 0,01 |
| **Sunoco LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2023 | | 1.000 | 1.024 | 0,01 |
| **Talen Energy Supply LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 (c) | | 900 | 898 | 0,01 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | | 3.700 | 3.760 | 0,04 |
| **Tech Data Corp.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.02.2027 | | 100 | 105 | 0,00 |
| **Tennessee Gas Pipeline Co. LLC** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.06.2032 | | 1.451 | 1.967 | 0,02 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2020 | | 1.500 | 1.520 | 0,02 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2040 | | 9.650 | 10.458 | 0,12 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2039 | | 1.700 | 1.975 | 0,02 |
| **Toll Brothers Finance Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.03.2027 | | 10.200 | 10.751 | 0,12 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **UAL Pass-Through Trust** | | | |
| 7,336 % fällig am 02.01.2021 | $ 211 | $ 213 | 0,00 |
| **VEREIT Operating Partnership LP** | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | 900 | 924 | 0,01 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 4,125 % fällig am 16.03.2027 | 5.500 | 5.987 | 0,07 |
| 5,250 % fällig am 16.03.2037 | 6.700 | 8.025 | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 16.03.2047 | 1.900 | 2.389 | 0,03 |
| **Vistra Energy Corp.** | | | |
| 7,375 % fällig am 01.11.2022 | 8.428 | 8.755 | 0,10 |
| **VMware, Inc.** | | | |
| 3,900 % fällig am 21.08.2027 | 1.000 | 1.015 | 0,01 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | |
| 4,000 % fällig am 12.11.2021 | 6.500 | 6.711 | 0,08 |
| **Washington Prime Group LP** | | | |
| 5,950 % fällig am 15.08.2024 | 8.060 | 7.667 | 0,09 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | |
| 7,950 % fällig am 15.03.2025 | 12.900 | 15.697 | 0,18 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | 33.200 | 34.372 | 0,40 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | |
| 4,500 % fällig am 29.04.2022 | 4.138 | 4.219 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 29.04.2025 | 8.329 | 8.615 | 0,10 |
| | | 1.252.552 | 14,50 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | |
| **California Resources Corp.** | | | |
| 7,152 % fällig am 31.12.2022 | 2.500 | 2.391 | 0,03 |
| **CenturyLink, Inc.** | | | |
| 5,152 % fällig am 31.01.2025 | 36.378 | 35.570 | 0,41 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | |
| 4,330 % fällig am 30.04.2025 | 34.995 | 34.990 | 0,41 |
| **CommScope, Inc.** | | | |
| 5,652 % fällig am 06.04.2026 | 800 | 800 | 0,01 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 4,410 % fällig am 07.09.2023 | 32.793 | 32.659 | 0,38 |
| **Envision Healthcare Corp.** | | | |
| 6,152 % fällig am 10.10.2025 | 3.582 | 3.119 | 0,04 |
| **Grifols Worldwide Operations USA, Inc.** | | | |
| 4,635 % fällig am 31.01.2025 | 30.690 | 30.638 | 0,36 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 4,330 % fällig am 13.03.2025 | 36.126 | 36.199 | 0,42 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | |
| 4,154 % fällig am 25.10.2023 | 28.723 | 28.771 | 0,33 |
| **Ineos Finance LLC** | | | |
| 2,500 % fällig am 31.03.2024 | € 33.496 | 38.026 | 0,44 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | |
| TBD % fällig am 21.05.2026 | $ 200 | 200 | 0,00 |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | |
| 4,152 % fällig am 27.03.2025 | 40.626 | 40.391 | 0,47 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | |
| 4,652 % fällig am 22.02.2024 | 26.500 | 26.315 | 0,30 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | |
| 4,412 % fällig am 04.10.2023 | 2.947 | 2.923 | 0,03 |
| **Unitymedia Finance LLC** | | | |
| 4,644 % fällig am 15.01.2026 | 600 | 599 | 0,01 |
| **VFH Parent LLC** | | | |
| 6,044 % fällig am 01.03.2026 | 2.900 | 2.909 | 0,03 |
| **Virgin Media Bristol LLC** | | | |
| 4,894 % fällig am 15.01.2026 | 35.230 | 35.146 | 0,41 |
| **Ziggo Secured Finance BV** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.04.2025 | € 14.600 | 16.619 | 0,19 |
| **Ziggo Secured Finance Partnership** | | | |
| 4,894 % fällig am 15.04.2025 | $ 18.000 | 17.664 | 0,20 |
| | | 385.929 | 4,47 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, (BABs), Series 2009** | | | |
| 6,449 % fällig am 15.02.2044 | 450 | 635 | 0,01 |
| **American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 8,084 % fällig am 15.02.2050 | 5.400 | 9.403 | 0,11 |
| **Chicago, Illinois Waterworks Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 6,642 % fällig am 01.11.2029 | $ 150 | $ 186 | 0,00 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 6,630 % fällig am 01.02.2035 | 1.880 | 2.170 | 0,02 |
| 6,725 % fällig am 01.04.2035 | 900 | 1.041 | 0,01 |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035 | 2.140 | 2.525 | 0,03 |
| **Los Angeles County, California Public Works Financing Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 7,618 % fällig am 01.08.2040 | 1.500 | 2.346 | 0,03 |
| **Massachusetts Port Authority Revenue Bonds, Series 2011** | | | |
| 6,202 % fällig am 01.07.2031 | 500 | 611 | 0,01 |
| **Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 6,637 % fällig am 01.04.2057 | 2.529 | 3.042 | 0,03 |
| 6,655 % fällig am 01.04.2057 | 4.557 | 5.963 | 0,07 |
| **Riverside, California Electric Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 7,605 % fällig am 01.10.2040 | 2.200 | 3.442 | 0,04 |
| **San Diego Redevelopment Agency, California Tax Allocation Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,625 % fällig am 01.09.2030 | 500 | 532 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2040 | 200 | 213 | 0,00 |
| **Texas Public Finance Authority Revenue Notes, Series 2014** | | | |
| 8,250 % fällig am 01.07.2024 | 1.765 | 1.774 | 0,02 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 7,467 % fällig am 01.06.2047 | 1.350 | 1.363 | 0,02 |
| | | 35.246 | 0,41 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 3,863 % fällig am 25.01.2036 ^ | 317 | 304 | 0,00 |
| 4,345 % fällig am 25.02.2036 ^ | 121 | 109 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 ^ | 910 | 869 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.06.2037 ^ | 233 | 214 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | |
| 4,044 % fällig am 25.09.2045 | 17 | 17 | 0,00 |
| 4,294 % fällig am 25.12.2035 | 881 | 524 | 0,01 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 ^ | 198 | 194 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 ^ | 200 | 195 | 0,00 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 2,593 % fällig am 20.04.2047 ^ | 560 | 512 | 0,01 |
| 2,694 % fällig am 25.07.2037 | 498 | 477 | 0,01 |
| 2,804 % fällig am 25.05.2037 ^ | 116 | 101 | 0,00 |
| 4,287 % fällig am 20.09.2047 ^ | 135 | 121 | 0,00 |
| 4,364 % fällig am 20.09.2035 ^ | 248 | 233 | 0,00 |
| 4,648 % fällig am 20.01.2047 ^ | 637 | 619 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 | 259 | 264 | 0,00 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 4,310 % fällig am 25.07.2035 ^ | 23 | 22 | 0,00 |
| 4,479 % fällig am 25.02.2036 ^ | 5 | 5 | 0,00 |
| 4,607 % fällig am 25.01.2035 | 99 | 96 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | 60 | 59 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.05.2047 ^ | 460 | 436 | 0,01 |
| 2,637 % fällig am 26.07.2036 | 78 | 76 | 0,00 |
| 3,054 % fällig am 25.09.2047 | 106 | 100 | 0,00 |
| 3,483 % fällig am 26.07.2036 | 250 | 243 | 0,00 |
| 6,227 % fällig am 26.08.2036 | 2.801 | 1.904 | 0,02 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 3,958 % fällig am 25.05.2034 | 36 | 36 | 0,00 |
| 4,190 % fällig am 25.06.2035 ^ | 22 | 21 | 0,00 |
| 4,238 % fällig am 25.01.2035 | 223 | 228 | 0,00 |
| 4,260 % fällig am 25.02.2036 ^ | 98 | 93 | 0,00 |
| 4,333 % fällig am 25.07.2036 ^ | 52 | 50 | 0,00 |
| 4,351 % fällig am 25.01.2035 | 5 | 5 | 0,00 |
| 4,376 % fällig am 25.03.2035 | 58 | 59 | 0,00 |
| 4,533 % fällig am 25.07.2034 | 115 | 118 | 0,00 |
| 4,792 % fällig am 25.12.2046 ^ | 167 | 155 | 0,00 |
| 4,795 % fällig am 25.10.2035 | 85 | 87 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 2,724 % fällig am 25.01.2047 ^ | 238 | 187 | 0,00 |
| 2,844 % fällig am 25.04.2035 | 201 | 201 | 0,00 |
| 2,844 % fällig am 25.04.2036 ^ | $ 165 | $ 191 | 0,00 |
| 4,016 % fällig am 25.08.2036 ^ | 361 | 246 | 0,00 |
| 4,110 % fällig am 25.11.2036 | 461 | 429 | 0,01 |
| 4,187 % fällig am 25.03.2036 | 530 | 383 | 0,01 |
| 4,294 % fällig am 25.09.2035 ^ | 112 | 95 | 0,00 |
| 4,477 % fällig am 25.05.2036 ^ | 631 | 482 | 0,01 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | |
| 4,284 % fällig am 26.01.2036 ^ | 207 | 184 | 0,00 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | |
| 3,004 % fällig am 25.02.2037 | 65 | 34 | 0,00 |
| 3,974 % fällig am 25.01.2036 ^ | 504 | 466 | 0,01 |
| 4,044 % fällig am 25.03.2037 ^ | 437 | 433 | 0,01 |
| 4,239 % fällig am 25.03.2037 ^ | 107 | 107 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | 80 | 60 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | 169 | 132 | 0,00 |
| **ChaseFlex Trust** | | | |
| 2,704 % fällig am 25.07.2037 | 256 | 231 | 0,00 |
| 6,300 % fällig am 25.06.2036 ^ | 99 | 90 | 0,00 |
| **Citicorp Mortgage Securities Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 | 95 | 103 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,644 % fällig am 25.11.2036 | 258 | 260 | 0,00 |
| 3,648 % fällig am 25.10.2046 ^ | 146 | 134 | 0,00 |
| 4,131 % fällig am 25.09.2037 | 112 | 112 | 0,00 |
| 4,262 % fällig am 25.07.2046 ^ | 340 | 316 | 0,00 |
| 4,291 % fällig am 25.09.2037 ^ | 171 | 167 | 0,00 |
| 4,643 % fällig am 25.09.2037 ^ | 850 | 855 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 4,680 % fällig am 25.09.2035 | 25 | 25 | 0,00 |
| 4,843 % fällig am 25.02.2034 | 91 | 92 | 0,00 |
| 5,130 % fällig am 25.03.2034 | 6 | 6 | 0,00 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | 87 | 86 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 1.092 | 1.092 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust** | | | |
| 4,484 % fällig am 25.03.2047 | 17 | 17 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | 353 | 287 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.08.2037 | 689 | 642 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.04.2047 | 1.182 | 1.132 | 0,01 |
| 2,563 % fällig am 20.02.2047 ^ | 305 | 242 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.12.2046 ^ | 13 | 13 | 0,00 |
| 2,573 % fällig am 20.09.2046 | 447 | 387 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.11.2036 | 303 | 295 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 ^ | 49 | 48 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.11.2036 | 105 | 100 | 0,00 |
| 2,593 % fällig am 20.03.2046 | 160 | 148 | 0,00 |
| 2,593 % fällig am 20.05.2046 ^ | 2.439 | 2.061 | 0,03 |
| 2,593 % fällig am 20.07.2046 ^ | 115 | 91 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.07.2046 ^ | 92 | 85 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 ^ | 463 | 426 | 0,01 |
| 2,713 % fällig am 20.11.2035 | 60 | 59 | 0,00 |
| 2,714 % fällig am 25.08.2035 ^ | 178 | 159 | 0,00 |
| 2,754 % fällig am 01.08.2036 ^ | 85 | 54 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.06.2035 | 123 | 121 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.04.2036 | 4.515 | 2.288 | 0,03 |
| 2,924 % fällig am 25.07.2035 | 104 | 102 | 0,00 |
| 3,400 % fällig am 25.08.2018 ^ | 7 | 4 | 0,00 |
| 3,984 % fällig am 25.01.2036 | 667 | 682 | 0,01 |
| 4,205 % fällig am 25.05.2036 | 471 | 436 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 ^ | 185 | 175 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | 637 | 563 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | 985 | 853 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2036 ^ | 410 | 274 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2035 | 431 | 442 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 ^ | 216 | 164 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | 525 | 408 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | 256 | 228 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | 90 | 80 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | 1.016 | 1.017 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 2.785 | 1.826 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | 780 | 560 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | 1.988 | 1.430 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 251 | 178 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 294 | 220 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | 60 | 49 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2047 ^ | 451 | 368 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036 ^ | 340 | 246 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2032 | 123 | 127 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | 1.162 | 791 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2037 ^ | 1.099 | 826 | 0,01 |
| 12,817 % fällig am 25.02.2036 | 536 | 703 | 0,01 |

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

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARK-TWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,654 % fällig am 25.03.2036 | $ 164 | $ 160 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.04.2046 | 8.719 | 3.977 | 0,05 |
| 3,084 % fällig am 25.03.2035 ^ | 89 | 84 | 0,00 |
| 3,464 % fällig am 25.04.2046 ^ | 922 | 463 | 0,01 |
| 3,806 % fällig am 25.10.2035 ^ | 425 | 371 | 0,01 |
| 3,865 % fällig am 25.03.2037 ^ | 117 | 109 | 0,00 |
| 3,895 % fällig am 20.10.2035 | 71 | 64 | 0,00 |
| 4,006 % fällig am 25.09.2037 ^ | 212 | 204 | 0,00 |
| 4,025 % fällig am 25.09.2047 ^ | 9 | 9 | 0,00 |
| 4,272 % fällig am 20.11.2035 ^ | 167 | 137 | 0,00 |
| 4,312 % fällig am 20.04.2035 | 14 | 14 | 0,00 |
| 4,405 % fällig am 20.12.2035 | 128 | 114 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2034 | 662 | 681 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | 442 | 446 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2035 | 88 | 78 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | 229 | 189 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 1.341 | 1.263 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | 58 | 50 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 ^ | 40 | 33 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.09.2036 ^ | 1.064 | 792 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | 280 | 196 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 4,252 % fällig am 25.06.2033 | 28 | 28 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | 428 | 320 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 4,300 % fällig am 28.04.2037 | 408 | 414 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | 243 | 170 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.02.2022 ^ | 618 | 167 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 25.08.2036 ^ | 911 | 788 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | 755 | 623 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.01.2047 | 122 | 120 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.08.2047 | 196 | 190 | 0,00 |
| **Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.** | | | |
| 2,548 % fällig am 27.11.2036 | 288 | 283 | 0,00 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | |
| 4,211 % fällig am 25.06.2036 ^ | 109 | 101 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 ^ | 98 | 75 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 4,623 % fällig am 25.09.2035 | 775 | 773 | 0,01 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,604 % fällig am 25.10.2046 ^ | 368 | 325 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.04.2036 ^ | 33 | 106 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,744 % fällig am 25.12.2034 | 10 | 10 | 0,00 |
| 4,040 % fällig am 25.04.2032 | 66 | 60 | 0,00 |
| 4,152 % fällig am 25.03.2047 ^ | 234 | 211 | 0,00 |
| 4,396 % fällig am 25.01.2036 ^ | 30 | 30 | 0,00 |
| 4,716 % fällig am 25.11.2035 | 228 | 231 | 0,00 |
| 4,757 % fällig am 25.04.2035 | 35 | 36 | 0,00 |
| 4,898 % fällig am 25.09.2035 | 251 | 254 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | 303 | 295 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 ^ | 87 | 93 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2037 ^ | 205 | 186 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 ^ | 620 | 521 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036 ^ | 375 | 294 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,700 % fällig am 19.11.2035 | 362 | 348 | 0,01 |
| 2,870 % fällig am 19.06.2035 | 692 | 697 | 0,01 |
| 2,930 % fällig am 19.03.2035 | 56 | 55 | 0,00 |
| 3,090 % fällig am 19.01.2035 | 531 | 476 | 0,01 |
| 3,960 % fällig am 19.06.2036 ^ | 274 | 181 | 0,00 |
| 4,526 % fällig am 19.08.2036 ^ | 5 | 5 | 0,00 |
| 4,534 % fällig am 19.08.2036 ^ | 89 | 84 | 0,00 |
| 4,697 % fällig am 19.07.2035 ^ | 80 | 73 | 0,00 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.12.2036 | 483 | 479 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.03.2035 | 259 | 227 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.01.2036 | 452 | 454 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.10.2035 | 286 | 289 | 0,00 |
| 2,734 % fällig am 25.10.2035 | 400 | 406 | 0,01 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.11.2035 | 1.989 | 1.817 | 0,02 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 2,514 % fällig am 25.05.2037 ^ | 147 | 126 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.03.2037 ^ | 816 | 768 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | 28 | 27 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.07.2047 | $ 332 | $ 284 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.06.2046 | 1.165 | 1.029 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.07.2035 | 248 | 239 | 0,00 |
| 2,884 % fällig am 25.07.2035 | 12 | 12 | 0,00 |
| 3,432 % fällig am 25.06.2037 ^ | 85 | 79 | 0,00 |
| 3,569 % fällig am 25.07.2037 | 67 | 56 | 0,00 |
| 3,736 % fällig am 25.06.2036 | 201 | 196 | 0,00 |
| 3,874 % fällig am 25.11.2035 ^ | 47 | 45 | 0,00 |
| 3,926 % fällig am 25.08.2035 | 1.148 | 1.045 | 0,01 |
| 4,024 % fällig am 25.05.2037 ^ | 277 | 246 | 0,00 |
| 4,099 % fällig am 25.11.2035 ^ | 887 | 855 | 0,01 |
| 4,335 % fällig am 25.12.2036 ^ | 119 | 114 | 0,00 |
| 4,386 % fällig am 25.06.2035 ^ | 482 | 462 | 0,01 |
| 4,403 % fällig am 25.10.2034 | 382 | 398 | 0,01 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 4,293 % fällig am 25.05.2036 ^ | 331 | 251 | 0,00 |
| 4,349 % fällig am 25.05.2037 ^ | 407 | 373 | 0,01 |
| 5,658 % fällig am 26.05.2037 | 3.214 | 2.758 | 0,03 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 3,970 % fällig am 25.06.2037 ^ | 487 | 430 | 0,01 |
| 4,222 % fällig am 25.11.2035 ^ | 246 | 240 | 0,00 |
| 4,248 % fällig am 25.10.2035 ^ | 276 | 256 | 0,00 |
| 4,259 % fällig am 25.10.2036 ^ | 677 | 618 | 0,01 |
| 4,512 % fällig am 25.08.2035 | 146 | 150 | 0,00 |
| 4,563 % fällig am 25.07.2035 | 36 | 36 | 0,00 |
| 4,760 % fällig am 25.04.2035 | 29 | 30 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2037 ^ | 7 | 7 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | 139 | 111 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 ^ | 310 | 225 | 0,00 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 2,634 % fällig am 25.04.2046 ^ | 48 | 47 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.09.2046 ^ | 18 | 15 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.02.2046 ^ | 385 | 356 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.08.2047 ^ | 826 | 743 | 0,01 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | |
| 3,004 % fällig am 25.05.2047 ^ | 504 | 727 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | |
| 2,514 % fällig am 25.03.2037 | 281 | 118 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.04.2037 | 48 | 48 | 0,00 |
| 2,600 % fällig am 25.02.2037 | 59 | 59 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,784 % fällig am 25.08.2035 | 464 | 466 | 0,01 |
| 2,864 % fällig am 25.04.2029 | 42 | 42 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.11.2029 | 6 | 6 | 0,00 |
| 4,103 % fällig am 25.05.2036 | 390 | 365 | 0,01 |
| 4,347 % fällig am 25.03.2036 ^ | 549 | 399 | 0,01 |
| 4,501 % fällig am 25.02.2036 | 76 | 78 | 0,00 |
| 4,691 % fällig am 25.11.2035 | 267 | 276 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,306 % fällig am 25.04.2037 ^ | 33 | 34 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust** | | | |
| 1,125 % fällig am 15.12.2048 (a) | 33.417 | 936 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,664 % fällig am 25.03.2036 | 127 | 104 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.01.2035 | 38 | 38 | 0,00 |
| 4,025 % fällig am 25.05.2036 ^ | 557 | 441 | 0,01 |
| 4,485 % fällig am 25.06.2036 | 6 | 6 | 0,00 |
| 4,526 % fällig am 25.06.2036 | 80 | 82 | 0,00 |
| 4,543 % fällig am 25.09.2035 ^ | 251 | 164 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 ^ | 1.369 | 1.126 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | |
| 3,246 % fällig am 26.02.2037 | 205 | 184 | 0,00 |
| 3,333 % fällig am 26.03.2037 | 146 | 135 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Resecuritization Trust** | | | |
| 3,050 % fällig am 26.01.2051 | 228 | 229 | 0,00 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | |
| 4,714 % fällig am 25.08.2035 | 186 | 188 | 0,00 |
| **Nomura Resecuritization Trust** | | | |
| 5,363 % fällig am 26.02.2037 | 2.248 | 2.255 | 0,03 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,684 % fällig am 25.12.2035 | 652 | 615 | 0,01 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | 397 | 374 | 0,01 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 2,504 % fällig am 25.05.2037 | 645 | 604 | 0,01 |
| 2,534 % fällig am 25.02.2037 | 452 | 440 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 | 669 | 653 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.02.2037 | $ 422 | $ 395 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.02.2047 | 1.070 | 621 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.08.2036 ^ | 336 | 317 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.09.2036 ^ | 956 | 909 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.08.2035 ^ | 959 | 817 | 0,01 |
| 2,804 % fällig am 25.11.2036 ^ | 326 | 247 | 0,00 |
| 4,378 % fällig am 25.02.2035 ^ | 83 | 72 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.03.2037 ^ | 155 | 144 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2035 ^ | 110 | 72 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | 731 | 683 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | 1.739 | 1.620 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 25.03.2037 ^ | 304 | 274 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2037 ^ | 430 | 406 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | 435 | 428 | 0,01 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | 121 | 101 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | 292 | 238 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037 ^ | 1.312 | 643 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | 240 | 229 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 187 | 178 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 3,808 % fällig am 20.01.2047 ^ | 8 | 7 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.06.2037 | 246 | 238 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.10.2035 | 140 | 136 | 0,00 |
| 3,874 % fällig am 25.11.2035 ^ | 63 | 59 | 0,00 |
| 4,044 % fällig am 25.10.2037 ^ | 108 | 100 | 0,00 |
| 4,099 % fällig am 25.10.2036 ^ | 126 | 102 | 0,00 |
| 4,226 % fällig am 25.04.2035 | 17 | 17 | 0,00 |
| 4,290 % fällig am 25.11.2036 ^ | 676 | 653 | 0,01 |
| 4,293 % fällig am 25.09.2035 | 43 | 38 | 0,00 |
| 4,451 % fällig am 25.02.2035 | 414 | 422 | 0,01 |
| 4,576 % fällig am 25.09.2035 | 287 | 280 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.07.2046 | 247 | 232 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.09.2047 | 84 | 81 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.06.2036 | 215 | 216 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.09.2047 | 1.093 | 1.074 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.04.2036 | 119 | 116 | 0,00 |
| 2,614 % fällig am 25.05.2036 | 77 | 73 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.08.2036 ^ | 621 | 535 | 0,01 |
| 3,050 % fällig am 19.10.2034 | 64 | 65 | 0,00 |
| 3,090 % fällig am 19.03.2034 | 8 | 8 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 4,413 % fällig am 25.06.2033 | 24 | 24 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.12.2034 | 38 | 38 | 0,00 |
| **SunTrust Alternative Loan Trust** | | | |
| 3,054 % fällig am 25.12.2035 ^ | 498 | 421 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 ^ | 573 | 560 | 0,01 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 4,131 % fällig am 25.09.2037 | 77 | 77 | 0,00 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust LLC** | | | |
| 4,604 % fällig am 20.10.2035 ^ | 119 | 120 | 0,00 |
| 4,704 % fällig am 20.03.2037 ^ | 187 | 184 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,345 % fällig am 27.02.2034 | 322 | 322 | 0,00 |
| 2,458 % fällig am 25.05.2046 | 109 | 105 | 0,00 |
| 2,595 % fällig am 25.10.2046 | 38 | 37 | 0,00 |
| 2,694 % fällig am 25.10.2045 | 74 | 74 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.06.2044 | 638 | 635 | 0,01 |
| 3,044 % fällig am 25.01.2045 | 717 | 720 | 0,01 |
| 3,144 % fällig am 25.11.2034 | 593 | 598 | 0,01 |
| 3,292 % fällig am 25.12.2046 | 114 | 115 | 0,00 |
| 3,314 % fällig am 25.07.2047 | 766 | 702 | 0,01 |
| 3,460 % fällig am 25.01.2037 ^ | 24 | 23 | 0,00 |
| 3,492 % fällig am 25.05.2037 ^ | 28 | 23 | 0,00 |
| 3,504 % fällig am 25.08.2046 | 721 | 675 | 0,01 |
| 3,566 % fällig am 25.04.2037 ^ | 16 | 15 | 0,00 |
| 3,597 % fällig am 25.07.2037 ^ | 839 | 767 | 0,01 |
| 3,683 % fällig am 25.12.2036 ^ | 16 | 15 | 0,00 |
| 3,704 % fällig am 25.11.2042 | 9 | 9 | 0,00 |
| 3,824 % fällig am 25.12.2036 ^ | 46 | 46 | 0,00 |
| 3,847 % fällig am 25.09.2036 ^ | 229 | 222 | 0,00 |
| 3,848 % fällig am 25.10.2036 ^ | 546 | 506 | 0,01 |
| 3,897 % fällig am 25.02.2037 ^ | 59 | 58 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.04.2044 | 4 | 4 | 0,00 |
| 3,905 % fällig am 25.08.2036 ^ | 101 | 99 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| 4,229 % fällig am 25.03.2036 | $ 320 | $ 314 | 0,00 |
| 4,243 % fällig am 25.12.2035 | 150 | 150 | 0,00 |
| 4,266 % fällig am 25.04.2035 | 28 | 29 | 0,00 |
| 4,512 % fällig am 25.02.2033 | 18 | 18 | 0,00 |
| 4,697 % fällig am 25.06.2033 | 73 | 75 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.02.2037 ^ | 1.167 | 941 | 0,01 |
| 2,854 % fällig am 25.05.2035 ^ | 402 | 339 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 ^ | 789 | 772 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | 229 | 228 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 1.009 | 1.049 | 0,01 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | |
| 5,750 % fällig am 25.07.2037 ^ | 101 | 99 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,741 % fällig am 25.11.2033 | 44 | 45 | 0,00 |
| 4,760 % fällig am 25.10.2036 ^ | 44 | 44 | 0,00 |
| 4,803 % fällig am 25.11.2037 ^ | 228 | 223 | 0,00 |
| 4,831 % fällig am 25.11.2034 | 382 | 396 | 0,01 |
| 4,859 % fällig am 25.04.2036 ^ | 480 | 486 | 0,01 |
| 4,869 % fällig am 25.12.2036 ^ | 180 | 179 | 0,00 |
| 4,905 % fällig am 25.10.2035 | 122 | 124 | 0,00 |
| 4,934 % fällig am 25.04.2036 | 4 | 4 | 0,00 |
| 5,008 % fällig am 25.07.2036 ^ | 1.249 | 1.274 | 0,02 |
| 5,085 % fällig am 25.03.2035 | 485 | 501 | 0,01 |
| 5,088 % fällig am 25.05.2036 ^ | 316 | 330 | 0,00 |
| 5,095 % fällig am 25.04.2035 | 58 | 59 | 0,00 |
| 5,165 % fällig am 25.04.2035 | 301 | 311 | 0,00 |
| 5,178 % fällig am 25.07.2036 ^ | 746 | 759 | 0,01 |
| 5,188 % fällig am 25.04.2036 ^ | 435 | 438 | 0,01 |
| 5,221 % fällig am 25.04.2036 ^ | 19 | 20 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 | 4 | 4 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | 552 | 558 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | 1.335 | 1.352 | 0,02 |
| | | 113.861 | 1,32 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 64.000 | 64.455 | 0,74 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 518.600 | 530.140 | 6,14 |
| | | 594.595 | 6,88 |
| Summe USA | | 2.660.939 | 30,80 |
| **URUGUAY** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Uruguay Government International Bond** | | | |
| 7,625 % fällig am 21.03.2036 | 100 | 143 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **VENEZUELA** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | $ 8.400 | $ 1.344 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Venezuela Government International Bond** | | | |
| 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^ | 2.651 | 719 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^ | 16.792 | 4.450 | 0,05 |
| 9,250 % fällig am 07.05.2028 ^ | 7.813 | 2.139 | 0,02 |
| | | 7.308 | 0,08 |
| Summe Venezuela | | 8.652 | 0,10 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| **Bank of Montreal** | | | |
| 1,787 % fällig am 22.07.2019 | CAD 3.300 | 2.523 | 0,03 |
| 1,797 % fällig am 19.07.2019 | 1.700 | 1.300 | 0,02 |
| 1,800 % fällig am 24.07.2019 | 600 | 459 | 0,01 |
| 1,802 % fällig am 12.07.2019 | 3.400 | 2.600 | 0,03 |
| 1,802 % fällig am 26.07.2019 | 2.000 | 1.529 | 0,02 |
| 1,806 % fällig am 31.07.2019 | 15.100 | 11.537 | 0,13 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | |
| 1,773 % fällig am 22.07.2019 | 4.600 | 3.516 | 0,04 |
| 1,775 % fällig am 23.07.2019 | 700 | 535 | 0,01 |
| 1,775 % fällig am 25.07.2019 | 1.500 | 1.146 | 0,01 |
| 1,781 % fällig am 26.07.2019 | 600 | 459 | 0,01 |
| 1,785 % fällig am 22.07.2019 | 3.900 | 2.981 | 0,03 |
| **C.I.B.C.** | | | |
| 1,802 % fällig am 12.07.2019 | 3.400 | 2.600 | 0,03 |
| **HSBC Bank Canada** | | | |
| 1,827 % fällig am 24.07.2019 | 3.700 | 2.828 | 0,03 |
| 1,828 % fällig am 25.07.2019 | 1.600 | 1.223 | 0,01 |
| 1,828 % fällig am 26.07.2019 | 2.700 | 2.063 | 0,02 |
| 1,854 % fällig am 11.07.2019 | 7.000 | 5.354 | 0,06 |
| **Royal Bank of Canada** | | | |
| 1,765 % fällig am 02.07.2019 | 5.900 | 4.514 | 0,05 |
| 1,773 % fällig am 22.07.2019 | 2.300 | 1.758 | 0,02 |
| 1,777 % fällig am 25.07.2019 | 1.900 | 1.452 | 0,02 |
| 1,777 % fällig am 26.07.2019 | 6.700 | 5.120 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| 1,795 % fällig am 31.07.2019 | 8.800 | 6.724 | 0,08 |
| 1,801 % fällig am 11.07.2019 | 3.100 | 2.371 | 0,03 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | |
| 1,765 % fällig am 02.07.2019 | 9.300 | 7.116 | 0,08 |
| 1,787 % fällig am 22.07.2019 | 3.900 | 2.981 | 0,03 |
| 1,788 % fällig am 24.07.2019 | 4.600 | 3.516 | 0,04 |
| 1,792 % fällig am 16.07.2019 | 700 | 535 | 0,01 |
| 1,792 % fällig am 26.07.2019 | $ 1.000 | $ 764 | 0,01 |
| 1,795 % fällig am 19.07.2019 | 3.600 | 2.752 | 0,03 |
| | | 82.256 | 0,95 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (k)** | | | |
| | | 1.143.732 | 13,24 |
| **GREECE TREASURY BILLS** | | | |
| 0,414 % fällig am 06.12.2019 (f)(g) | 4.400 | 5.004 | 0,06 |
| 0,556 % fällig am 04.10.2019 (f)(g) | € 9.000 | 10.242 | 0,12 |
| 0,587 % fällig am 04.10.2019 (f)(g) | 31.400 | 35.733 | 0,41 |
| 0,618 % fällig am 30.08.2019 (f)(g) | 12.270 | 13.967 | 0,16 |
| 0,729 % fällig am 30.08.2019 (f)(g) | 14.700 | 16.734 | 0,19 |
| | | 81.680 | 0,94 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 1.307.668 | 15,13 |

| | ANZAHL | | |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)** | 24.144.313 | 241.805 | 2,80 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 8.959.712** | **103,70** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 156 | $ 106 | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09/2019 | 742 | 137 | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 7.803 | 12.145 | 0,14 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 12.597 | 24.720 | 0,29 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 1.482 | 8.606 | 0,10 |
| | | | | $ 45.714 | 0,53 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures | $ 126,500 | 26.07.2019 | 542 | $ (139) | $ (76) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 542 | (122) | (144) | 0,00 |
| | | | | $ (261) | $ (220) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 45.494** | **0,53** |

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

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Koninklijke KPN N.V. | (1,000) % | 20.12.2023 | € 100 | $ (1) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 35.000 | $ 151 | 0,00 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 1,000 | 20.12.2020 | € 24.200 | (1.492) | (0,02) |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 1,000 | 20.12.2021 | 11.000 | (1.323) | (0,02) |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 1,000 | 20.06.2023 | 3.300 | (388) | 0,00 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 1,000 | 20.12.2023 | 3.000 | (321) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.06.2023 | $ 30.600 | (1.301) | (0,01) |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.12.2023 | 3.900 | (222) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2022 | 600 | (39) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2023 | 500 | (1) | 0,00 |
| Frontier Communications Corp. | 5,000 | 20.06.2020 | 5.300 | (914) | (0,01) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 16.400 | 998 | 0,01 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 6.400 | 29 | 0,00 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 26.200 | 341 | 0,00 |
| Navient Corp. | 5,000 | 20.12.2022 | $ 1.450 | 4 | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A.U. | 1,000 | 20.12.2023 | € 23.300 | 594 | 0,01 |
| Telefonica Emisiones S.A.U. | 1,000 | 20.06.2024 | 7.900 | 51 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.06.2024 | 4.900 | 17 | 0,00 |
| | | | | $ (3.816) | (0,04) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 685.600 | $ 11.184 | 0,13 |
| CDX.HY-32 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2024 | 518.500 | 7.743 | 0,09 |
| CDX.IG-31 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2023 | 28.200 | 342 | 0,00 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 522.000 | 2.113 | 0,03 |
| | | | | $ 21.382 | 0,25 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,500 % | 19.06.2029 | CAD 59.100 | $ 1.941 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | $ 67.300 | 2.468 | 0,03 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | € 14.300 | 326 | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 18.12.2029 | 49.100 | (546) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | 83.400 | (971) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.12.2049 | 50.100 | (350) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | £ 63.200 | (1.528) | (0,02) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2029 | 6.900 | (327) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 6.000 | (616) | (0,01) |
| | | | | | $ 397 | 0,00 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 17.962** | **0,21** |

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

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

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

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

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 % | 21.08.2019 | 15.300 | $ (18) | $ (3) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 21.200 | (20) | (5) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 26.100 | (41) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 26.900 | (46) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 5.700 | (6) | (1) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 21.500 | (25) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 16.900 | (19) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 18.09.2019 | 31.900 | (59) | (13) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 61.300 | (119) | (21) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 47.800 | (85) | (14) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 80.900 | (147) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 18.500 | (29) | (5) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 15.600 | (17) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 19.000 | (29) | (5) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 5.400 | (6) | (1) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 18.500 | (32) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,900 | 17.06.2020 | 112.400 | (101) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 33.000 | (33) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 21.700 | (25) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 27.600 | (54) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 70.300 | (111) | (21) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 3,000 | 17.06.2020 | 112.400 | (114) | (26) | 0,00 |
| JLN | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 18.09.2019 | 31.400 | (64) | (13) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 7.500 | (12) | (2) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 14.900 | (25) | (4) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 14.700 | (15) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | $ (1.252) | $ (227) | 0,00 |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,650 % | 12.07.2019 | 81.700 | $ (149) | $ (105) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,000 | 12.07.2019 | 81.700 | (149) | (15) | 0,00 |
| FBF | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,130 | 05.07.2019 | 42.200 | (110) | (623) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,640 | 19.07.2019 | 82.700 | (174) | (141) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,000 | 19.07.2019 | 82.700 | (149) | (32) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (731) | $ (916) | (0,01) |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2022 | $ 350 | $ (21) | $ 21 | $ 0 | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2025 | 34.400 | (1.545) | 1.145 | (400) | (0,01) |
| | Kazakhstan Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 7.500 | (590) | 684 | 94 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.09.2022 | 12.500 | (458) | 572 | 114 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 27.520 | (1.082) | 761 | (321) | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.03.2023 | 7.400 | (201) | 381 | 180 | 0,00 |
| CBK | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 8.100 | (269) | 84 | (185) | 0,00 |
| GST | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 9.000 | (292) | 87 | (205) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 29.580 | (1.163) | 818 | (345) | 0,00 |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 500 | (17) | 10 | (7) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 4.900 | (143) | 31 | (112) | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 93.700 | (767) | 683 | (84) | 0,00 |
| JPM | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 800 | (49) | 50 | 1 | 0,00 |
| UAG | Avolon Holdings Ltd. | 5,000 | 01.07.2020 | 600 | 35 | (10) | 25 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.09.2022 | 8.900 | (326) | 407 | 81 | 0,00 |
| | | | | | $ (6.888) | $ 5.724 | $ (1.164) | (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.

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 62.600 | 20.12.2019 | $ (385) | $ 1.040 | $ 655 | 0,01 |
| CBK | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 5.000 | 20.09.2019 | (32) | 259 | 227 | 0,00 |
| JPM | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.400 | 20.09.2019 | (13) | 82 | 69 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (430) | $ 1.381 | $ 951 | 0,01 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 7.170 | $ | 5.007 | $ 0 | $ (24) | $ (24) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 6.847 | | 7.688 | 0 | (109) | (109) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 50.958 | € | 44.944 | 224 | 0 | 224 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 5.012 | AUD | 7.170 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 10.219 | BRL | 39.527 | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 233.887 | $ | 33.725 | 0 | (289) | (289) | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 53.703 | | 39.234 | 0 | (506) | (506) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 23.648 | CNH | 162.747 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 15.103 | KRW | 17.463.837 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 18.881 | TWD | 581.691 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 221.895 | $ | 7.075 | 0 | (133) | (133) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | CAD | 15.200 | | 11.535 | 0 | (97) | (97) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 24.763 | | 28.016 | 17 | (201) | (184) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 930 | ARS | 46.787 | 128 | 0 | 128 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.058 | AUD | 1.530 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.013 | CAD | 1.334 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.228 | € | 1.095 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 6.246 | £ | 4.962 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 135 | TRY | 802 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 670 | MXN | 13.348 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 16.716.302 | $ | 14.187 | 0 | (285) | (285) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 23.660 | CNH | 162.747 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 20.700 | TWD | 637.242 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 13.348 | $ | 662 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € | 1.343.301 | | 1.502.444 | 0 | (27.307) | (27.307) | (0,32) |
| | 07/2019 | £ | 4.456 | | 5.682 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 19.726 | £ | 15.571 | 91 | 0 | 91 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 10.658 | IDR | 152.121.634 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | ARS | 97.925 | $ | 2.009 | 0 | (206) | (206) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 516.469 | | 654.391 | 0 | (2.920) | (2.920) | (0,03) |
| | 07/2019 | ¥ | 603.039 | | 5.535 | 0 | (62) | (62) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4.181 | AUD | 6.040 | 57 | 0 | 57 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.059 | CAD | 1.429 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 641.556 | £ | 504.943 | 1.085 | 0 | 1.085 | 0,01 |
| | 08/2019 | £ | 496.839 | $ | 632.250 | 0 | (1.061) | (1.061) | (0,01) |
| FBF | 09/2019 | $ | 287 | INR | 20.168 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | CAD | 14.500 | $ | 11.061 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 16.675 | | 18.773 | 0 | (217) | (217) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 6.829 | | 8.680 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.247 | € | 1.099 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 11.477 | RUB | 725.002 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | | 22.050 | BRL | 85.367 | 162 | 0 | 162 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 21.728 | IDR | 310.384.480 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 17.590 | MXN | 342.181 | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | AUD | 9 | $ | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 11.960 | | 13.604 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.384 | ARS | 68.692 | 169 | 0 | 169 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 17 | £ | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 34.769 | RUB | 2.304.672 | 1.701 | 0 | 1.701 | 0,02 |
| | 08/2019 | | 10.302 | BRL | 39.894 | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 60.038 | $ | 8.739 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 328.833 | | 16.797 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 712.998 | | 22.775 | 0 | (388) | (388) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | CAD | 15.800 | | 11.988 | 0 | (109) | (109) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 14.586 | | 16.446 | 0 | (165) | (165) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.937 | € | 2.598 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.871 | £ | 2.278 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5.631 | ¥ | 608.500 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 228 | PLN | 858 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 585 | ZAR | 8.525 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 10.185 | IDR | 145.472.355 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 19.099 | KRW | 22.062.595 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | | 30.242 | RUB | 1.910.387 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 09/2019 | RUB | 2.298.754 | $ | 34.740 | 0 | (1.314) | (1.314) | (0,02) |
| MYI | 07/2019 | CAD | 3.600 | | 2.733 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| RBC | 09/2019 | $ | 6.221 | KRW | 7.185.379 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| RYL | 07/2019 | CAD 34.700 | $ 26.469 | $ 0 | $ (102) | $ (102) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 16.900 | 12.692 | 0 | (244) | (244) | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR 2.870.879 | 196 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW 29.792.358 | 25.027 | 0 | (765) | (765) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ 39.586 | SGD 53.675 | 133 | 0 | 133 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD 283.662 | $ 9.064 | 0 | (152) | (152) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | AUD 400 | 279 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD 4.600 | 3.493 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD 10 | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | CAD 2.300 | 1.745 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | ¥ 5.461 | 51 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 51 | ¥ 5.461 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH 36.154 | $ 5.212 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ 163 | MYR 678 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 4.320 | $ (37.072) | $ (32.752) | (0,38) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Administrative AUD (Hedged) ausschüttend und M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD 10.154 | $ 7.091 | $ 0 | $ (34) | $ (34) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 4.816 | AUD 6.951 | 61 | 0 | 61 | 0,00 |
| | 08/2019 | 7.098 | 10.154 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | 5.744 | 8.195 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD 10.418 | $ 7.285 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 4.578 | AUD 6.612 | 63 | 0 | 63 | 0,00 |
| | 08/2019 | 7.098 | 10.138 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | AUD 201 | $ 139 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 43 | 30 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 407 | AUD 586 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 199 | 285 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 5.402 | 7.786 | 62 | 0 | 62 | 0,00 |
| | | | | $ 257 | $ (63) | $ 194 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CAD 8.039 | $ 6.112 | $ 0 | $ (40) | $ (40) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 5.761 | CAD 7.788 | 199 | 0 | 199 | 0,01 |
| | 08/2019 | 6.116 | 8.039 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | 67 | 91 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD 8.027 | $ 6.117 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 5.848 | CAD 7.883 | 185 | 0 | 185 | 0,00 |
| | 08/2019 | 6.121 | 8.027 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 5.817 | 7.840 | 183 | 0 | 183 | 0,00 |
| | | | | $ 635 | $ (66) | $ 569 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ 4.322 | CHF 4.335 | $ 124 | $ 0 | $ 124 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF 4.468 | $ 4.563 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 4.321 | CHF 4.330 | 120 | 0 | 120 | 0,00 |
| | 08/2019 | 4.576 | 4.468 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | 4.347 | 4.374 | 140 | 0 | 140 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CHF 4.476 | $ 4.582 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 7 | CHF 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | 4.595 | 4.476 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 34 | 33 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 22 | 22 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 415 | $ (29) | $ 386 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 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 und Class T EUR (Hedged) ausschüttenddie folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 1.198.056 | $ 1.361.470 | $ 0 | $ (2.876) | $ (2.876) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ 1.364.940 | € 1.198.056 | 2.893 | 0 | 2.893 | 0,03 |
| BPS | 07/2019 | 70.501 | 62.667 | 866 | (2) | 864 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | 1.229.421 | 1.099.197 | 22.345 | 0 | 22.345 | 0,26 |
| CBK | 07/2019 | € 1.198.056 | $ 1.361.590 | 0 | (2.756) | (2.756) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ 82.390 | € 72.586 | 313 | (41) | 272 | 0,00 |
| | 08/2019 | 1.365.063 | 1.198.056 | 2.769 | 0 | 2.769 | 0,03 |
| GLM | 07/2019 | 1.235.139 | 1.106.732 | 25.207 | 0 | 25.207 | 0,29 |
| RBC | 07/2019 | 5.742 | 5.062 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | 55.478 | 49.049 | 379 | 0 | 379 | 0,01 |
| SCX | 07/2019 | 25.900 | 22.987 | 277 | 0 | 277 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 1.229.631 | 1.101.025 | 24.217 | 0 | 24.217 | 0,28 |
| | | | | $ 79.289 | $ (5.675) | $ 73.614 | 0,85 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Administrative GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | £ 3.978 | $ 5.051 | $ 0 | $ (12) | $ (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 796 | £ 631 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 532.584 | $ 675.506 | 0 | (2.314) | (2.314) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ 6.469 | £ 5.091 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08/2019 | 675.761 | 531.971 | 2.332 | 0 | 2.332 | 0,03 |
| CBK | 07/2019 | £ 527.894 | $ 670.741 | 0 | (1.110) | (1.110) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 652.128 | £ 514.683 | 2.910 | 0 | 2.910 | 0,04 |
| | 08/2019 | 671.769 | 527.894 | 1.127 | 0 | 1.127 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | 16.067 | 12.710 | 110 | 0 | 110 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | £ 91 | $ 116 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 7.986 | £ 6.256 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | £ 949 | $ 1.210 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | $ 651.433 | £ 514.683 | 3.604 | 0 | 3.604 | 0,04 |
| SSB | 07/2019 | 639.604 | 506.196 | 4.632 | 0 | 4.632 | 0,05 |
| | | | | $ 14.735 | $ (3.461) | $ 11.274 | 0,13 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ 10.066 | SEK 95.929 | $ 273 | $ 0 | $ 273 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | 10.132 | 96.509 | 269 | 0 | 269 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | 67 | 636 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | SEK 98.951 | $ 10.665 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 10.690 | SEK 98.951 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SEK 98.980 | $ 10.673 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 10.161 | SEK 97.228 | 318 | 0 | 318 | 0,01 |
| | 08/2019 | 10.698 | 98.980 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | | | | $ 867 | $ (5) | $ 862 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Administrative SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 09/2019 | $ 99 | SGD 135 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| BRC | 09/2019 | 497 | 673 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 09/2019 | 7 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 09/2019 | 389 | 527 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| JPM | 09/2019 | 496 | 672 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 09/2019 | 532 | 720 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 5 | $ 0 | $ 5 | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 52.796** | **0,61** |
| **Summe Anlagen** | **$ 9.075.964** | **105,05** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (436.288)** | **(5,05)** |
| **Nettovermögen** | **$ 8.639.676** | **100,00** |

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

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

**^** **Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a)** **Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(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.**

**Barmittel in Höhe von USD 173.511 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 7.609 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BCY | 2,650 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 99.200 | U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.11.2022 | $ (101.270) | $ 99.200 | $ 99.222 | 1,15 |
| | 2,780 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 634.700 | U.S. Treasury Notes 1,875 % - 2,250 % fällig am 31.03.2022 - 15.11.2024 | (647.974) | 634.700 | 634.847 | 7,35 |
| BOS | 2,800 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 265.300 | U.S. Treasury Bonds 3,125 % - 3,750 % fällig am 15.11.2043 - 15.08.2044 | (273.227) | 265.300 | 265.362 | 3,07 |
| FICC | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 51.932 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | (52.975) | 51.932 | 51.941 | 0,60 |
| MBC | 2,680 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 67.600 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 30.04.2024 | (69.833) | 67.600 | 67.615 | 0,78 |
| RVM | 2,800 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 25.000 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.11.2027 | (25.542) | 25.000 | 25.006 | 0,29 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.170.821)** | **$ 1.143.732** | **$ 1.143.993** | **13,24** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 838.071 | $ 8.080.428 | $ 41.213 | $ 8.959.712 |
| Finanzderivate[3] | 45.494 | 70.733 | 25 | 116.252 |
| **Summen** | **$ 883.565** | **$ 8.151.161** | **$ 41.238** | **$ 9.075.964** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 680.567 | $ 6.403.551 | $ 60.818 | $ 7.144.936 |
| Finanzderivate[3] | 49.954 | (43.576) | 30 | 6.408 |
| **Summen** | **$ 730.521** | **$ 6.359.975** | **$ 60.848** | **$ 7.151.344** |

[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.

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (198) | $ 410 | $ 212 |
| BPS | 524 | 360 | 884 |
| BRC | (4.585) | 4.300 | (285) |
| CBK | 631 | (640) | (9) |
| CKL | (32) | 0 | (32) |
| DUB | (10) | (70) | (80) |
| FBF | (622) | 530 | (92) |
| GLM | 25.141 | (23.360) | 1.781 |
| GST | (636) | 719 | 83 |
| HUS | 1.472 | (530) | 942 |
| JLN | (15) | 0 | (15) |
| JPM | (102) | 0 | (102) |
| MSB | (1.325) | 0 | (1.325) |
| MYC | (3) | 0 | (3) |
| MYI | (19) | 1.290 | 1.271 |
| RBC | 22 | 0 | 22 |
| RYL | 277 | (1.040) | (763) |
| SCX | 3.229 | (640) | 2.589 |
| SSB | 29.002 | (24.460) | 4.542 |
| TOR | (16) | 0 | (16) |
| UAG | 61 | 0 | 61 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 60,27 | 61,11 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 29,59 | 37,01 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 13,84 | 6,66 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,53 | 0,73 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,21 | (0,50) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,61 | (0,14) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 0,00 | (0,15) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 1,42 | 1,57 |
| Australien | 0,01 | 0,00 |
| Österreich | 0,06 | 0,01 |
| Bermuda | 0,31 | 0,35 |
| Brasilien | 0,79 | 0,97 |
| Kanada | 0,22 | 0,16 |
| Cayman-Inseln | 3,35 | 3,06 |
| Chile | 0,05 | 0,06 |
| China | 0,02 | 0,03 |
| Kolumbien | 0,71 | 0,78 |
| Costa Rica | 0,03 | 0,02 |
| Kroatien | 0,08 | 0,04 |
| Curacao | 0,28 | 0,35 |
| Dänemark | 0,00 | 0,15 |
| Dominikanische Republik | 0,31 | 0,35 |
| Ecuador | 0,48 | 0,42 |
| Ägypten | 0,52 | 0,20 |
| Frankreich | 2,13 | 1,92 |
| Deutschland | 2,71 | 2,13 |
| Ghana | 0,18 | 0,00 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,36 | 0,26 |
| Hongkong | 0,03 | 0,04 |
| Indien | 0,11 | 0,10 |
| Indonesien | 1,02 | 0,96 |
| Irland | 7,99 | 9,58 |
| Insel Man | 0,07 | 0,00 |
| Italien | 2,48 | 2,72 |
| Japan | 0,50 | 0,80 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,94 | 1,53 |
| Kasachstan | 0,37 | 0,44 |
| Kenia | 0,08 | 0,00 |
| Luxemburg | 3,97 | 4,54 |
| Mazedonien | 0,02 | 0,03 |
| Mexiko | 1,41 | 1,84 |
| Niederlande | 3,66 | 4,79 |
| Nigeria | 0,02 | 0,02 |
| Norwegen | 0,10 | 0,00 |
| Oman | 0,46 | 0,42 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Panama | 0,37 | 0,43 |
| Polen | 0,34 | 0,00 |
| Katar | 1,02 | 1,19 |
| Rumänien | 0,29 | 0,33 |
| Russland | 0,63 | 0,06 |
| Saudi-Arabien | 0,49 | 0,58 |
| Senegal | 0,05 | 0,06 |
| Südafrika | 0,67 | 0,19 |
| Spanien | 1,19 | 1,41 |
| Schweden | 0,02 | 0,00 |
| Schweiz | 1,52 | 1,82 |
| Trinidad und Tobago | 0,05 | 0,05 |
| Tunesien | 0,03 | 0,01 |
| Türkei | 2,36 | 2,50 |
| Ukraine | 1,23 | 1,28 |
| Großbritannien | 7,36 | 9,51 |
| Vereinigte Staaten | 30,80 | 35,40 |
| Venezuela | 0,10 | 0,09 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 2,80 | 1,65 |
| Kurzfristige Instrumente | 15,13 | 7,58 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,53 | 0,73 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,04) | (0,09) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,25 | (0,36) |
| Zinsswaps | 0,00 | (0,05) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,02) |
| Zinsswapoption | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | (0,17) |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,01 | (0,02) |
| Devisenterminkontrakte | (0,38) | 0,03 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,00 | 0,04 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (5,05) | (4,87) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Diversified Income Duration Hedged Fund

| BESCHREIBUNG | | PAR (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | € | 1.500 | $ | 1.338 | 0,10 |
| 3,380 % fällig am 31.12.2038 | | 23.350 | | 15.200 | 1,10 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2027 | | 2.600 | | 2.172 | 0,16 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | | 1.750 | | 1.457 | 0,10 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | ARS | 3.400 | | 78 | 0,01 |
| Summe Argentinien | | | | 20.245 | 1,47 |
| **AUSTRALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.03.2028 | $ | 200 | | 204 | 0,01 |
| **Virgin Australia Pass-Through Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 23.04.2022 | | 70 | | 72 | 0,01 |
| Summe Australien | | | | 276 | 0,02 |
| **ÖSTERREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **IMMOFINANZ AG** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 27.01.2023 | € | 700 | | 834 | 0,06 |
| **BERMUDA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Bacardi Ltd.** | | | | | |
| 4,700 % fällig am 15.05.2028 | $ | 4.500 | | 4.818 | 0,35 |
| **BRASILIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 10.10.2022 | | 290 | | 296 | 0,02 |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.07.2019 (e)(g) | | 2.332 | | 25 | 0,01 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | | |
| 5,299 % fällig am 27.01.2025 | | 7.118 | | 7.570 | 0,55 |
| 7,375 % fällig am 17.01.2027 | | 2.400 | | 2.750 | 0,20 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 21.11.2036 | | 352 | | 425 | 0,03 |
| Summe Brasilien | | | | 11.066 | 0,81 |
| **KANADA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 1.100 | | 1.344 | 0,10 |
| **Fairstone Financial, Inc.** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.07.2024 (c) | $ | 600 | | 613 | 0,04 |
| **Harvest Operations Corp.** | | | | | |
| 2,330 % fällig am 14.04.2021 | | 504 | | 502 | 0,04 |
| | | | | 2.459 | 0,18 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | | | |
| 5,412 % fällig am 02.06.2025 | | 459 | | 460 | 0,03 |
| Summe Kanada | | | | 2.919 | 0,21 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Apex Credit CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,632 % fällig am 27.10.2028 | | 900 | | 901 | 0,07 |
| **Madison Park Funding Ltd.** | | | | | |
| 3,922 % fällig am 20.04.2026 | | 700 | | 703 | 0,05 |
| | | | | 1.604 | 0,12 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **21Vianet Group, Inc.** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2021 | | 500 | | 516 | 0,04 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2023 | | 600 | | 637 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | | 900 | | 962 | 0,07 |
| **Baidu, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 29.09.2023 | $ | 200 | $ | 207 | 0,02 |
| **China Evergrande Group** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 2.100 | | 2.030 | 0,15 |
| 9,500 % fällig am 11.04.2022 | | 2.500 | | 2.484 | 0,18 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.04.2024 | | 1.100 | | 1.135 | 0,08 |
| **Lima Metro Line Finance Ltd.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 1.300 | | 1.386 | 0,10 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 700 | | 697 | 0,05 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | | 1.687 | | 1.678 | 0,12 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 (d) | | 4.317 | | 2.687 | 0,20 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 | | 170 | | 164 | 0,01 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | | |
| 7,720 % fällig am 01.12.2026 (d) | | 696 | | 178 | 0,01 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2021 | | 100 | | 101 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 3.500 | | 3.621 | 0,26 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 270 | | 286 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | | 500 | | 540 | 0,04 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 8.000 | | 8.020 | 0,58 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 5.800 | | 5.814 | 0,42 |
| **Sands China Ltd.** | | | | | |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 1.400 | | 1.524 | 0,11 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.08.2020 | | 200 | | 203 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 | | 3.600 | | 3.602 | 0,26 |
| 7,950 % fällig am 11.10.2023 | | 3.200 | | 3.225 | 0,23 |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 | | 200 | | 205 | 0,02 |
| 8,375 % fällig am 15.01.2021 | | 200 | | 207 | 0,02 |
| 8,625 % fällig am 27.07.2020 | | 700 | | 722 | 0,05 |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** | | | | | |
| 1,544 % fällig am 28.07.2038 | £ | 300 | | 343 | 0,03 |
| **Transocean Guardian Ltd.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2024 | $ | 1.512 | | 1.544 | 0,11 |
| **Transocean Poseidon Ltd.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.02.2027 | | 200 | | 212 | 0,02 |
| **UPCB Finance Ltd.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2027 | € | 3.420 | | 4.113 | 0,30 |
| | | | | 49.043 | 3,57 |
| Summe Cayman Inseln | | | | 50.647 | 3,69 |
| **CHILE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **GNL Quintero S.A.** | | | | | |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029 | $ | 600 | | 637 | 0,05 |
| **CHINA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 29.09.2019 | | 600 | | 599 | 0,04 |
| **KOLUMBIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Colombia Government International Bond** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045 | | 8.800 | | 9.733 | 0,71 |
| 5,625 % fällig am 26.02.2044 | | 500 | | 593 | 0,04 |
| Summe Kolumbien | | | | 10.326 | 0,75 |
| **COSTA RICA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Costa Rica Government International Bond** | | | | | |
| 7,158 % fällig am 12.03.2045 | | 300 | | 302 | 0,02 |
| **KROATIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Croatia Government International Bond** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 19.06.2029 | € | 500 | | 571 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 14.07.2020 | $ | 400 | $ | 416 | 0,03 |
| Summe Kroatien | | | | 987 | 0,07 |
| **CURACAO** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Teva Pharmaceutical Finance BV** | | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | | 600 | | 582 | 0,05 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Co. BV** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 18.12.2022 | | 630 | | 576 | 0,04 |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | | 6.000 | | 5.797 | 0,42 |
| Summe Curacao | | | | 6.955 | 0,51 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Dominican Republic International Bond** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.02.2048 | | 2.500 | | 2.650 | 0,19 |
| 6,850 % fällig am 27.01.2045 | | 1.500 | | 1.645 | 0,12 |
| 6,875 % fällig am 29.01.2026 | | 500 | | 566 | 0,04 |
| Summe Dominikanische Republik | | | | 4.861 | 0,35 |
| **ECUADOR** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ecuador Government International Bond** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 23.01.2028 | | 900 | | 893 | 0,07 |
| 8,875 % fällig am 23.10.2027 | | 1.900 | | 1.983 | 0,14 |
| 9,650 % fällig am 13.12.2026 | | 900 | | 976 | 0,07 |
| 10,750 % fällig am 28.03.2022 | | 2.000 | | 2.253 | 0,16 |
| 10,750 % fällig am 31.01.2029 | | 800 | | 905 | 0,07 |
| Summe Ecuador | | | | 7.010 | 0,51 |
| **ÄGYPTEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Egypt Government International Bond** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 11.04.2025 | € | 2.800 | | 3.265 | 0,24 |
| 4,750 % fällig am 16.04.2026 | | 900 | | 1.032 | 0,07 |
| 5,625 % fällig am 16.04.2030 | | 100 | | 112 | 0,01 |
| 6,375 % fällig am 11.04.2031 | | 1.500 | | 1.741 | 0,13 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2047 | $ | 1.600 | | 1.700 | 0,12 |
| Summe Ägypten | | | | 7.850 | 0,57 |
| **FRANKREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Altice France S.A.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.02.2027 | € | 1.000 | | 1.236 | 0,09 |
| 7,375 % fällig am 01.05.2026 | $ | 8.400 | | 8.631 | 0,63 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 16.11.2027 | | 400 | | 410 | 0,03 |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 9.900 | | 10.628 | 0,77 |
| 5,198 % fällig am 10.01.2030 | | 1.200 | | 1.375 | 0,10 |
| **BPCE S.A.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 11.01.2023 | | 400 | | 403 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 22.05.2022 | | 300 | | 303 | 0,02 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 21.09.2028 | | 1.200 | | 1.317 | 0,10 |
| 4,750 % fällig am 13.10.2035 | | 200 | | 219 | 0,02 |
| **La Mondiale SAM** | | | | | |
| 5,050 % fällig am 17.12.2025 (g) | € | 2.100 | | 2.691 | 0,19 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.01.2027 | $ | 300 | | 312 | 0,02 |
| | | | | 27.525 | 2,00 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **Numericable Group S.A.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2026 | € | 4.531 | | 5.002 | 0,37 |
| 5,152 % fällig am 31.07.2025 | $ | 1.477 | | 1.410 | 0,10 |
| 6,082 % fällig am 31.01.2026 | | 197 | | 191 | 0,01 |
| | | | | 6.603 | 0,48 |
| Summe Frankreich | | | | 34.128 | 2,48 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **ADLER Real Estate AG** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 27.04.2026 | € | 200 | | 237 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PAR (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,180 % fällig am 07.12.2020 | € | 400 | $ 450 | 0,03 |
| 0,327 % fällig am 10.09.2021 | | 300 | 334 | 0,02 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 2.000 | 2.297 | 0,17 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2020 | £ | 200 | 254 | 0,02 |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | € | 1.100 | 1.272 | 0,09 |
| 3,150 % fällig am 22.01.2021 | $ | 600 | 596 | 0,04 |
| 3,375 % fällig am 12.05.2021 | | 2.800 | 2.789 | 0,20 |
| 3,751 % fällig am 27.02.2023 | | 2.000 | 1.929 | 0,14 |
| 3,875 % fällig am 12.02.2024 | £ | 1.900 | 2.481 | 0,18 |
| 4,250 % fällig am 04.02.2021 | $ | 1.400 | 1.413 | 0,10 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 7.300 | 7.403 | 0,54 |
| 5,000 % fällig am 14.02.2022 | | 1.600 | 1.650 | 0,12 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (d) | € | 1.000 | 1.167 | 0,09 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (d) | | 5.350 | 6.190 | 0,45 |
| **Schaeffler AG** | | | | |
| 2,875 % fällig am 26.03.2027 | | 400 | 496 | 0,04 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,250 % fällig am 10.06.2024 | | 1.300 | 1.513 | 0,11 |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 100 | 120 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 31.07.2026 | | 100 | 123 | 0,01 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,875 % fällig am 12.04.2023 | | 100 | 115 | 0,01 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.01.2024 | | 2.800 | 3.458 | 0,25 |
| | | | 36.287 | 2,64 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2027 | | 2.000 | 2.281 | 0,17 |
| Summe Deutschland | | | 38.568 | 2,81 |
| **GHANA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ghana Government International Bond** | | | | |
| 7,875 % fällig am 26.03.2027 | $ | 800 | 844 | 0,06 |
| 8,125 % fällig am 26.03.2032 | | 800 | 815 | 0,06 |
| 8,950 % fällig am 26.03.2051 | | 800 | 830 | 0,06 |
| Summe Ghana | | | 2.489 | 0,18 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 300 | 314 | 0,02 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 1.232 | 1.284 | 0,09 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 20.06.2022 | € | 800 | 967 | 0,07 |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | | 2.000 | 2.424 | 0,18 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | 4.989 | 0,36 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CNOOC Finance Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 09.05.2023 | $ | 600 | 606 | 0,04 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 03.07.2029 (c) | | 400 | 406 | 0,03 |
| **ONGC Videsh Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.07.2019 | | 400 | 400 | 0,03 |
| | | | 806 | 0,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 3,375 % fällig am 05.08.2026 | | 1.200 | 1.204 | 0,09 |
| Summe Indien | | | 2.010 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | | PAR (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Pelabuhan Indonesia Persero PT** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | $ | 700 | $ 750 | 0,06 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 6,500 % fällig am 07.11.2048 | | 5.900 | 7.308 | 0,53 |
| **Perusahaan Listrik Negara PT** | | | | |
| 5,450 % fällig am 21.05.2028 | | 400 | 444 | 0,03 |
| | | | 8.502 | 0,62 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 1,450 % fällig am 18.09.2026 | € | 700 | 816 | 0,06 |
| 3,375 % fällig am 30.07.2025 | | 800 | 1.033 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 14.06.2028 | | 4.200 | 5.723 | 0,42 |
| | | | 7.572 | 0,55 |
| Summe Indonesien | | | 16.074 | 1,17 |
| **IRLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € | 1.700 | 1.960 | 0,14 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.02.2022 | $ | 6.000 | 6.175 | 0,45 |
| 4,250 % fällig am 01.07.2020 | | 400 | 406 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | | 600 | 619 | 0,05 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 700 | 718 | 0,05 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (g)(i) | € | 900 | 1.084 | 0,08 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | |
| 3,373 % fällig am 15.11.2025 | $ | 300 | 304 | 0,02 |
| 4,418 % fällig am 15.11.2035 | | 800 | 793 | 0,06 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 24.05.2023 | £ | 700 | 989 | 0,07 |
| **James Hardie International Finance Co.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2026 | € | 900 | 1.090 | 0,08 |
| **Novatek OAO via Novatek Finance DAC** | | | | |
| 6,604 % fällig am 03.02.2021 | $ | 200 | 210 | 0,02 |
| **Russian Railways via RZD Capital PLC** | | | | |
| 7,487 % fällig am 25.03.2031 | £ | 1.550 | 2.449 | 0,18 |
| **Smurfit Kappa Acquisitions ULC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.01.2026 | € | 1.800 | 2.236 | 0,16 |
| | | | 19.033 | 1,39 |
| | | ANZAHL | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (h)** | | 521.370 | 52.914 | 3,85 |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)** | | 385.172 | 4.083 | 0,30 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (h)** | | 5.099.104 | 51.450 | 3,74 |
| | | | 55.533 | 4,04 |
| Summe Irland | | | 127.480 | 9,28 |
| | | PARI (000S) | | |
| **INSEL MAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NE Property BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.05.2023 | € | 700 | 819 | 0,06 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | $ | 1.800 | 1.806 | 0,13 |
| 5,710 % fällig am 15.01.2026 | | 1.600 | 1.620 | 0,12 |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | | 6.100 | 6.422 | 0,47 |

| BESCHREIBUNG | | PAR (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 7,000 % fällig am 19.01.2021 (g)(i) | € | 2.100 | $ 2.523 | 0,18 |
| **Leonardo SpA** | | | | |
| 8,000 % fällig am 16.12.2019 | £ | 3.000 | 3.935 | 0,29 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 3,750 % fällig am 12.04.2022 | $ | 200 | 202 | 0,01 |
| 6,497 % fällig am 14.01.2022 | | 1.200 | 1.249 | 0,09 |
| 6,572 % fällig am 14.01.2022 | | 1.100 | 1.170 | 0,09 |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (g)(i) | € | 500 | 602 | 0,04 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 6.000 | 6.859 | 0,50 |
| **Wind Tre SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 20.01.2023 | € | 5.400 | 6.208 | 0,45 |
| 2,750 % fällig am 20.01.2024 | | 1.300 | 1.464 | 0,11 |
| 3,125 % fällig am 20.01.2025 | | 700 | 797 | 0,06 |
| Summe Italien | | | 34.857 | 2,54 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **SoftBank Group Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2028 | | 5.000 | 6.476 | 0,47 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 4,133 % fällig am 09.03.2021 | $ | 400 | 408 | 0,03 |
| Summe Japan | | | 6.884 | 0,50 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 700 | 815 | 0,06 |
| 2,875 % fällig am 31.07.2043 | | 2.900 | 3.522 | 0,26 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 300 | 377 | 0,03 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 1.100 | 1.349 | 0,10 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025 | | 1.100 | 1.298 | 0,09 |
| 3,950 % fällig am 30.06.2022 | £ | 3.800 | 4.954 | 0,36 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 12.315 | 0,90 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kazakhstan Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 21.07.2025 | $ | 4.200 | 4.755 | 0,35 |
| 6,500 % fällig am 21.07.2045 | | 600 | 832 | 0,06 |
| Summe Kasachstan | | | 5.587 | 0,41 |
| **KENIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kenya Government International Bond** | | | | |
| 8,000 % fällig am 22.05.2032 | | 1.200 | 1.270 | 0,09 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Allergan Funding SCS** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.11.2023 | € | 100 | 119 | 0,01 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.05.2026 | $ | 6.760 | 6.811 | 0,50 |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2025 | € | 1.200 | 1.362 | 0,10 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | | 2.166 | 2.535 | 0,19 |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | $ | 1.500 | 1.417 | 0,10 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 2.700 | 2.923 | 0,21 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(d) | | 402 | 193 | 0,01 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 | € | 5.400 | 6.164 | 0,45 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | | 1.000 | 1.156 | 0,08 |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | | 300 | 350 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 2.700 | 2.798 | 0,20 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (e) | € | 6.320 | 6.972 | 0,51 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 06.04.2024 | £ | 2.900 | 3.927 | 0,29 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.04.2024 | € | 1.800 | 2.070 | 0,15 |

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

| BESCHREIBUNG | | PAR (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Logicor Financing SARL** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | € | 2.400 | $ | 3.033 | 0,22 |
| **Nielsen Co. Luxembourg SARL** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2021 | $ | 5.100 | | 5.132 | 0,37 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 2.200 | | 2.339 | 0,17 |
| **Telenet Finance Luxembourg Notes SARL** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2028 | € | 1.600 | | 1.893 | 0,14 |
| Summe Luxemburg | | | | 51.194 | 3,73 |
| **MAZEDONIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **North Macedonia Government International Bond** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.01.2025 | | 300 | | 361 | 0,03 |
| **MEXIKO** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027 | | 2.600 | | 2.602 | 0,19 |
| 3,750 % fällig am 21.02.2024 | | 2.500 | | 2.838 | 0,21 |
| 4,750 % fällig am 26.02.2029 | | 6.600 | | 7.206 | 0,52 |
| 4,875 % fällig am 21.02.2028 | | 3.200 | | 3.573 | 0,26 |
| 6,500 % fällig am 13.03.2027 | $ | 1.100 | | 1.089 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 2.700 | | 2.508 | 0,18 |
| **Trust F** | | | | | |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 600 | | 616 | 0,05 |
| | | | | 20.432 | 1,49 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 08.03.2044 | | 1.600 | | 1.674 | 0,12 |
| Summe Mexiko | | | | 22.106 | 1,61 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (g)(i) | € | 3.100 | | 3.680 | 0,27 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (g)(i) | | 2.600 | | 3.284 | 0,24 |
| **ING Bank NV** | | | | | |
| 5,800 % fällig am 25.09.2023 | $ | 5.400 | | 5.977 | 0,43 |
| **NN Group NV** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (g) | € | 3.700 | | 4.663 | 0,34 |
| **NXP BV** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.03.2024 | $ | 2.500 | | 2.683 | 0,20 |
| 5,350 % fällig am 01.03.2026 | | 2.350 | | 2.605 | 0,19 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 950 | | 1.122 | 0,08 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | $ | 200 | | 208 | 0,01 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 8.800 | | 9.192 | 0,67 |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 1.600 | | 1.666 | 0,12 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 15.10.2024 | € | 1.200 | | 1.135 | 0,08 |
| 1,250 % fällig am 31.03.2023 | | 1.300 | | 1.323 | 0,10 |
| 2,800 % fällig am 21.07.2023 | $ | 1.700 | | 1.475 | 0,11 |
| 4,500 % fällig am 01.03.2025 | € | 1.900 | | 2.083 | 0,15 |
| **VIVAT NV** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 17.05.2024 | | 400 | | 484 | 0,04 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 16.11.2027 | | 700 | | 869 | 0,06 |
| 3,250 % fällig am 18.11.2030 | | 2.300 | | 2.978 | 0,22 |
| 4,125 % fällig am 16.11.2038 | | 1.500 | | 2.085 | 0,15 |
| 4,625 % fällig am 27.06.2028 (g) | | 2.300 | | 2.802 | 0,20 |
| | | | | 50.314 | 3,66 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **Sigma Bidco BV** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.07.2025 | | 2.500 | | 2.792 | 0,21 |
| Summe Niederlande | | | | 53.106 | 3,87 |
| **NIGERIA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Nigeria Government International Bond** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 16.02.2032 | $ | 300 | | 314 | 0,02 |
| **NORWEGEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Aker BP ASA** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.06.2024 | $ | 1.400 | $ | 1.446 | 0,11 |
| **OMAN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Oman Government International Bond** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.03.2047 | | 2.800 | | 2.427 | 0,18 |
| 6,750 % fällig am 17.01.2048 | | 3.800 | | 3.363 | 0,24 |
| Summe Oman | | | | 5.790 | 0,42 |
| **PANAMA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banistmo S.A.** | | | | | |
| 3,650 % fällig am 19.09.2022 | | 300 | | 302 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Panama Government International Bond** | | | | | |
| 6,700 % fällig am 26.01.2036 | | 3.600 | | 4.914 | 0,36 |
| 8,125 % fällig am 28.04.2034 | | 100 | | 142 | 0,01 |
| | | | | 5.056 | 0,37 |
| Summe Panama | | | | 5.358 | 0,39 |
| **POLEN** | | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **PCF GmbH** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | € | 5.300 | | 5.910 | 0,43 |
| **KATAR** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | $ | 2.500 | | 2.926 | 0,21 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | | |
| 5,838 % fällig am 30.09.2027 | | 2.700 | | 3.070 | 0,23 |
| | | | | 5.996 | 0,44 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **State Of Qatar** | | | | | |
| 2,983 % fällig am 21.12.2020 | | 5.000 | | 4.988 | 0,36 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 23.04.2028 | | 2.000 | | 2.241 | 0,16 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 1.100 | | 1.313 | 0,10 |
| | | | | 3.554 | 0,26 |
| Summe Katar | | | | 14.538 | 1,06 |
| **RUMÄNIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 19.04.2027 | € | 3.100 | | 3.835 | 0,28 |
| **RUSSLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **ALROSA Finance S.A.** | | | | | |
| 4,650 % fällig am 09.04.2024 | $ | 700 | | 726 | 0,05 |
| **MMK International Capital DAC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 13.06.2024 | | 1.500 | | 1.523 | 0,11 |
| | | | | 2.249 | 0,16 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 04.12.2025 | € | 4.800 | | 5.861 | 0,43 |
| 5,625 % fällig am 04.04.2042 | $ | 800 | | 940 | 0,07 |
| | | | | 6.801 | 0,50 |
| Summe Russland | | | | 9.050 | 0,66 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Saudi Government International Bond** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | $ | 800 | $ | 811 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 6.300 | | 6.715 | 0,49 |
| 5,000 % fällig am 17.04.2049 | | 300 | | 329 | 0,02 |
| Summe Saudi-Arabien | | | | 7.855 | 0,57 |
| **SENEGAL** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Senegal Government International Bond** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 13.03.2028 | € | 200 | | 229 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 23.05.2033 | $ | 600 | | 582 | 0,04 |
| Summe Senegal | | | | 811 | 0,06 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | | 400 | | 422 | 0,03 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 16.09.2025 | | 8.200 | | 9.001 | 0,66 |
| Summe Südafrika | | | | 9.423 | 0,69 |
| **SPANIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (g)(i) | € | 200 | | 240 | 0,02 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (g)(i) | | 9.000 | | 10.551 | 0,77 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (g)(i) | | 1.800 | | 2.160 | 0,16 |
| **Bankinter S.A.** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 08.07.2026 (c) | | 1.100 | | 1.251 | 0,09 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 01.02.2024 | | 300 | | 366 | 0,02 |
| | | | | 14.568 | 1,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | | 2.300 | | 2.834 | 0,21 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 700 | | 820 | 0,06 |
| | | | | 3.654 | 0,27 |
| Summe Spanien | | | | 18.222 | 1,33 |
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Samhallsbyggnadsbolaget Norden AB** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2025 | | 200 | | 232 | 0,02 |
| **SCHWEIZ** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (i) | $ | 12.700 | | 14.010 | 1,02 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (i) | | 4.850 | | 5.442 | 0,40 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.04.2026 | | 2.900 | | 3.101 | 0,22 |
| Summe Schweiz | | | | 22.553 | 1,64 |
| **TRINIDAD UND TOBAGO** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Trinidad & Tobago Government International Bond** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.08.2026 | | 700 | | 701 | 0,05 |
| **TUNESIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Banque Centrale de Tunisie International Bond** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 17.02.2024 | € | 400 | | 454 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PAR (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **TÜRKEI** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Turkey Government International Bond** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 11.04.2023 | € | 700 | $ | 806 | 0,06 |
| 4,875 % fällig am 09.10.2026 | $ | 7.100 | | 6.372 | 0,46 |
| 5,125 % fällig am 25.03.2022 | | 8.300 | | 8.197 | 0,60 |
| 5,125 % fällig am 17.02.2028 | | 5.700 | | 5.104 | 0,37 |
| 5,750 % fällig am 22.03.2024 | | 4.600 | | 4.498 | 0,33 |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047 | | 1.800 | | 1.513 | 0,11 |
| 6,125 % fällig am 24.10.2028 | | 900 | | 851 | 0,06 |
| 7,250 % fällig am 23.12.2023 | | 2.700 | | 2.795 | 0,20 |
| Summe Türkei | | | | 30.136 | 2,19 |
| **UKRAINE** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 20.06.2026 | € | 1.000 | | 1.209 | 0,09 |
| 7,375 % fällig am 25.09.2032 | $ | 600 | | 592 | 0,04 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2019 | | 7.800 | | 7.839 | 0,57 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2020 | | 5.000 | | 5.171 | 0,38 |
| 8,994 % fällig am 01.02.2024 | | 1.700 | | 1.856 | 0,13 |
| 9,750 % fällig am 01.11.2028 | | 1.800 | | 2.037 | 0,15 |
| Summe Ukraine | | | | 18.704 | 1,36 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Avon International Capital PLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.08.2022 (c) | | 700 | | 707 | 0,05 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (i) | | 1.400 | | 1.530 | 0,11 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 7.600 | | 11.124 | 0,81 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 4,338 % fällig am 16.05.2024 | $ | 1.400 | | 1.447 | 0,10 |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | | 1.600 | | 1.656 | 0,12 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (g)(i) | € | 1.400 | | 1.614 | 0,12 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (g)(i) | £ | 200 | | 257 | 0,02 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (g)(i) | | 1.100 | | 1.462 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (g)(i) | | 1.800 | | 2.432 | 0,18 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (g)(i) | € | 400 | | 494 | 0,04 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | | |
| 9,625 % fällig am 15.12.2030 | $ | 1.200 | | 1.811 | 0,13 |
| **Co-operative Group Holdings Ltd.** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 08.07.2026 | £ | 100 | | 143 | 0,01 |
| **EI Group PLC** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | | 1.900 | | 2.580 | 0,19 |
| 6,875 % fällig am 09.05.2025 | | 900 | | 1.239 | 0,09 |
| **Ensco Rowan PLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.10.2044 | $ | 400 | | 232 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 31.01.2024 | | 628 | | 535 | 0,04 |
| **FCE Bank PLC** | | | | | |
| 0,869 % fällig am 13.09.2021 | € | 500 | | 571 | 0,04 |
| 1,875 % fällig am 24.06.2021 | | 300 | | 350 | 0,03 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | | |
| 2,866 % fällig am 15.03.2036 | £ | 200 | | 204 | 0,01 |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | | 300 | | 443 | 0,03 |
| **HBOS PLC** | | | | | |
| 5,374 % fällig am 30.06.2021 | € | 1.000 | | 1.252 | 0,09 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 3,600 % fällig am 25.05.2023 | $ | 400 | | 416 | 0,03 |
| 4,041 % fällig am 13.03.2028 | | 500 | | 526 | 0,04 |
| 4,300 % fällig am 08.03.2026 | | 400 | | 430 | 0,03 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.05.2026 | € | 3.000 | | 3.468 | 0,25 |
| **John Lewis PLC** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | £ | 200 | | 287 | 0,02 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | | 3.800 | | 4.860 | 0,35 |
| 4,450 % fällig am 08.05.2025 | $ | 400 | | 426 | 0,03 |
| 6,375 % fällig am 27.06.2020 (g)(i) | € | 600 | | 710 | 0,05 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.12.2023 | £ | 500 | | 651 | 0,05 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | | |
| 1,236 % fällig am 15.12.2030 | | 310 | | 370 | 0,03 |
| 2,860 % fällig am 15.12.2030 | $ | 1.240 | | 1.158 | 0,08 |
| 6,469 % fällig am 15.09.2032 | £ | 632 | | 910 | 0,07 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | $ | 5.000 | | 5.223 | 0,38 |
| **RAC Bond Co. PLC** | | | | | |
| 4,870 % fällig am 06.05.2046 | £ | 1.100 | $ | 1.378 | 0,10 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.03.2026 | € | 1.200 | | 1.401 | 0,10 |
| 2,000 % fällig am 08.03.2023 | | 1.900 | | 2.236 | 0,16 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 100 | | 118 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | | 3.600 | | 4.357 | 0,32 |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | $ | 200 | | 200 | 0,01 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | | 7.200 | | 7.708 | 0,56 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (g)(i) | | 1.200 | | 1.233 | 0,09 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (g)(i) | | 2.600 | | 2.809 | 0,20 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 0,505 % fällig am 27.03.2024 | € | 700 | | 784 | 0,06 |
| 2,875 % fällig am 05.08.2021 | $ | 300 | | 301 | 0,02 |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | | 200 | | 202 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (g)(i) | £ | 4.200 | | 5.594 | 0,41 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | | |
| 3,474 % fällig am 28.12.2031 | | 100 | | 126 | 0,01 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 3.745 | | 6.091 | 0,44 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 97 | | 161 | 0,01 |
| **TP ICAP PLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | | 900 | | 1.199 | 0,09 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 700 | | 913 | 0,07 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2021 | | 600 | | 791 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 07.09.2023 | | 2.600 | | 3.416 | 0,25 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | | 1.550 | | 2.217 | 0,16 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | | 5.000 | | 6.568 | 0,48 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | | 2.600 | | 3.420 | 0,25 |
| 5,125 % fällig am 15.01.2025 | | 300 | | 397 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 15.05.2029 | $ | 1.100 | | 1.119 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 28.03.2029 | £ | 100 | | 135 | 0,01 |
| | | | | 106.392 | 7,74 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 4.700 | | 6.005 | 0,44 |
| Summe Großbritannien | | | | 112.397 | 8,18 |
| **USA** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | | | |
| 3,184 % fällig am 25.10.2035 | $ | 200 | | 200 | 0,02 |
| 3,604 % fällig am 25.06.2035 | | 630 | | 617 | 0,05 |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,945 % fällig am 25.09.2035 | | 100 | | 97 | 0,01 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.02.2036 | | 376 | | 376 | 0,03 |
| **Aircraft Certificate Owner Trust** | | | | | |
| 7,001 % fällig am 20.09.2022 | | 35 | | 36 | 0,00 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.11.2035 | | 200 | | 199 | 0,01 |
| 5,779 % fällig am 25.11.2032 ^ | | 775 | | 786 | 0,06 |
| **Argent Securities Trust** | | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.05.2036 | | 662 | | 250 | 0,02 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.10.2035 | | 601 | | 604 | 0,04 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.02.2037 | | 192 | | 211 | 0,02 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | | 123 | | 123 | 0,01 |
| 2,744 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 106 | | 91 | 0,01 |
| 2,824 % fällig am 25.12.2035 | | 300 | | 301 | 0,02 |
| 3,409 % fällig am 25.06.2035 | | 941 | | 944 | 0,07 |
| 4,204 % fällig am 25.07.2034 | | 130 | | 130 | 0,01 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.01.2037 | | 158 | | 152 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.02.2037 | | 1.000 | | 943 | 0,07 |
| 3,454 % fällig am 25.05.2035 | | 300 | | 300 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 3,334 % fällig am 25.05.2035 | | 200 | | 201 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | $ | 31 | $ | 31 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.05.2037 | | 196 | | 195 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.05.2037 | | 310 | | 309 | 0,02 |
| 2,584 % fällig am 25.11.2047 ^ | | 1.055 | | 880 | 0,06 |
| 2,694 % fällig am 25.07.2036 | | 52 | | 52 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.06.2036 | | 135 | | 136 | 0,01 |
| 2,724 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.600 | | 1.364 | 0,10 |
| 2,844 % fällig am 25.04.2036 | | 1.500 | | 1.506 | 0,11 |
| 2,854 % fällig am 25.03.2036 | | 100 | | 99 | 0,01 |
| 2,894 % fällig am 25.02.2036 | | 200 | | 200 | 0,02 |
| 2,954 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 1.561 | | 1.248 | 0,09 |
| 2,964 % fällig am 25.04.2034 | | 176 | | 171 | 0,01 |
| 3,004 % fällig am 25.11.2033 | | 521 | | 514 | 0,04 |
| 3,454 % fällig am 25.11.2034 | | 263 | | 264 | 0,02 |
| 4,763 % fällig am 25.07.2036 | | 11 | | 11 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.03.2037 | | 25 | | 25 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.05.2036 | | 397 | | 398 | 0,03 |
| 3,064 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 6.000 | | 5.491 | 0,40 |
| 3,244 % fällig am 25.10.2047 | | 4.445 | | 4.450 | 0,32 |
| 3,979 % fällig am 25.11.2034 | | 200 | | 194 | 0,01 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 3,024 % fällig am 25.01.2032 | | 8 | | 8 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Asset-Backed Trust** | | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.09.2037 | | 216 | | 212 | 0,02 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.05.2037 | | 639 | | 641 | 0,05 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.04.2036 (b)(e) | | 1.275 | | 1.149 | 0,08 |
| 3,679 % fällig am 25.07.2034 | | 423 | | 426 | 0,03 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.04.2036 | | 300 | | 188 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 700 | | 665 | 0,05 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.11.2036 | | 97 | | 42 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | | | |
| 2,454 % fällig am 25.12.2046 | | 33 | | 20 | 0,00 |
| 2,494 % fällig am 25.01.2037 | | 59 | | 40 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.05.2046 | | 28 | | 28 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.06.2036 | | 278 | | 189 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2036 | | 876 | | 756 | 0,06 |
| 3,139 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 211 | | 211 | 0,02 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | | |
| 3,499 % fällig am 25.05.2035 | | 200 | | 201 | 0,01 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.06.2036 | | 132 | | 130 | 0,01 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | | |
| 3,034 % fällig am 25.02.2036 | | 270 | | 272 | 0,02 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 856 | | 498 | 0,04 |
| 2,594 % fällig am 25.03.2047 | | 600 | | 589 | 0,04 |
| 2,664 % fällig am 25.07.2036 | | 420 | | 415 | 0,03 |
| 2,664 % fällig am 25.06.2037 | | 500 | | 494 | 0,04 |
| **Lehman XS Trust** | | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | | 57 | | 56 | 0,00 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2046 | | 651 | | 309 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.02.2036 | | 1.198 | | 1.047 | 0,08 |
| 3,164 % fällig am 25.08.2045 | | 635 | | 641 | 0,05 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 2,504 % fällig am 25.08.2036 | | 4.347 | | 1.831 | 0,13 |
| 2,554 % fällig am 25.03.2036 | | 1.626 | | 1.416 | 0,10 |
| 3,094 % fällig am 25.03.2035 | | 1.400 | | 1.409 | 0,10 |
| 3,154 % fällig am 25.12.2034 ^ | | 30 | | 30 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.04.2034 | | 179 | | 178 | 0,01 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.05.2037 | | 303 | | 238 | 0,02 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2036 | | 301 | | 170 | 0,01 |
| 2,984 % fällig am 25.01.2035 | | 560 | | 560 | 0,04 |
| 3,109 % fällig am 25.01.2035 | | 290 | | 290 | 0,02 |
| 4,330 % fällig am 25.02.2047 | | 208 | | 193 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust** | | | | | |
| 3,979 % fällig am 25.11.2032 | | 125 | | 125 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 3,109 % fällig am 25.08.2035 | | 920 | | 925 | 0,07 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 5,404 % fällig am 25.01.2033 ^ | | 344 | | 319 | 0,02 |

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

| BESCHREIBUNG | | PAR (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,894 % fällig am 25.05.2035 | $ | 873 | $ 879 | 0,06 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.09.2037 | | 1.045 | 1.031 | 0,08 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.01.2037 | | 353 | 236 | 0,02 |
| 3,139 % fällig am 25.08.2035 | | 892 | 896 | 0,07 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.09.2035 | | 2.064 | 2.079 | 0,15 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.08.2035 | | 561 | 564 | 0,04 |
| 3,454 % fällig am 25.09.2034 | | 26 | 26 | 0,00 |
| 4,204 % fällig am 25.12.2034 | | 473 | 493 | 0,04 |
| **RAAC Trust** | | | | |
| 2,934 % fällig am 25.12.2035 | | 142 | 143 | 0,01 |
| 3,604 % fällig am 25.09.2047 | | 217 | 219 | 0,02 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 2,794 % fällig am 25.02.2036 | | 403 | 404 | 0,03 |
| 3,334 % fällig am 25.05.2035 | | 740 | 744 | 0,05 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | | 105 | 105 | 0,01 |
| 3,079 % fällig am 25.09.2035 | | 57 | 57 | 0,00 |
| 3,094 % fällig am 25.11.2035 | | 300 | 299 | 0,02 |
| 3,109 % fällig am 25.09.2035 | | 1.000 | 981 | 0,07 |
| 3,289 % fällig am 25.01.2034 | | 134 | 134 | 0,01 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,869 % fällig am 25.03.2036 | | 700 | 649 | 0,05 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 2,494 % fällig am 25.07.2036 | | 111 | 57 | 0,00 |
| 3,079 % fällig am 25.01.2035 | | 59 | 58 | 0,00 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.05.2036 | | 262 | 262 | 0,02 |
| 2,714 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 12.298 | 8.910 | 0,65 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 3,229 % fällig am 25.05.2035 | | 111 | 112 | 0,01 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.03.2036 | | 391 | 374 | 0,03 |
| 2,824 % fällig am 25.11.2035 | | 500 | 496 | 0,04 |
| 3,139 % fällig am 25.08.2035 | | 288 | 289 | 0,02 |
| 3,379 % fällig am 25.10.2033 | | 282 | 283 | 0,02 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,404 % fällig am 25.08.2037 | | 516 | 520 | 0,04 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,864 % fällig am 25.09.2035 | | 400 | 388 | 0,03 |
| **Truman Capital Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.03.2036 | | 1.886 | 1.867 | 0,14 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | | 298 | 248 | 0,02 |
| | | | 64.813 | 4,72 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alliance Data Systems Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.11.2021 | | 1.500 | 1.545 | 0,11 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 1.062 | 1.065 | 0,08 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 1.183 | 1.197 | 0,09 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 2.207 | 2.928 | 0,21 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 100 | 102 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2027 | | 100 | 106 | 0,01 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.08.2037 | | 900 | 972 | 0,07 |
| 5,300 % fällig am 15.08.2058 | | 7.200 | 8.031 | 0,58 |
| **Broadcom Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.01.2022 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 15.03.2023 | | 100 | 103 | 0,01 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2024 | | 100 | 103 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 17.06.2022 | | 300 | 323 | 0,02 |
| **Catalent Pharma Solutions, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2027 | | 100 | 102 | 0,01 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | | 900 | 936 | 0,07 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 4.000 | 4.205 | 0,31 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 (c) | | 2.100 | 2.153 | 0,16 |
| 5,375 % fällig am 01.04.2038 | $ | 100 | $ 107 | 0,01 |
| **Cheniere Corpus Christi Holdings LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.06.2027 | | 1.300 | 1.415 | 0,10 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 132 | 140 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2023 | | 230 | 246 | 0,02 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 01.05.2026 | | 100 | 104 | 0,01 |
| **Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2022 | | 500 | 512 | 0,04 |
| **Cogent Communications Group, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 30.06.2024 | € | 700 | 802 | 0,06 |
| **CommScope Technologies LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | $ | 200 | 175 | 0,01 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.01.2028 | | 2.000 | 2.107 | 0,15 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 09.03.2023 | | 1.700 | 1.759 | 0,13 |
| **CyrusOne LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2024 | | 100 | 103 | 0,01 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2020 | | 3.720 | 3.729 | 0,27 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | | 1.100 | 1.148 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 15.11.2023 | | 100 | 105 | 0,01 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 5,300 % fällig am 01.10.2029 | | 3.300 | 3.481 | 0,25 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 1.800 | 1.941 | 0,14 |
| 6,020 % fällig am 15.06.2026 | | 600 | 662 | 0,05 |
| 8,100 % fällig am 15.07.2036 | | 300 | 370 | 0,03 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | € | 500 | 622 | 0,05 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | $ | 845 | 851 | 0,06 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | | 350 | 333 | 0,02 |
| 6,750 % fällig am 01.06.2021 | | 4.400 | 4.626 | 0,34 |
| 7,750 % fällig am 01.07.2026 | | 2.700 | 2.626 | 0,19 |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 145 | 146 | 0,01 |
| **Doctors Co.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.10.2023 | | 1.800 | 1.943 | 0,14 |
| **El Paso Natural Gas Co. LLC** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.06.2032 | | 100 | 134 | 0,01 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 700 | 696 | 0,05 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.02.2023 | | 400 | 409 | 0,03 |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | | 800 | 814 | 0,06 |
| 5,250 % fällig am 15.04.2029 | | 100 | 112 | 0,01 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.11.2023 | | 1.200 | 1.268 | 0,09 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2022 | | 4.900 | 5.211 | 0,38 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2022 | | 2.400 | 2.575 | 0,19 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.03.2024 | € | 2.200 | 2.625 | 0,19 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.10.2022 | $ | 592 | 628 | 0,05 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.11.2031 | | 2.100 | 2.873 | 0,21 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | € | 1.900 | 2.119 | 0,15 |
| 0,100 % fällig am 07.12.2022 | | 200 | 219 | 0,02 |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | | 300 | 338 | 0,02 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | | 1.300 | 1.570 | 0,11 |
| 3,336 % fällig am 18.03.2021 | $ | 600 | 603 | 0,04 |
| 3,484 % fällig am 12.10.2021 | | 600 | 591 | 0,04 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 600 | 644 | 0,05 |
| 5,596 % fällig am 07.01.2022 | | 1.800 | 1.906 | 0,14 |
| 5,729 % fällig am 07.01.2022 | | 200 | 206 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 02.08.2021 | | 200 | 211 | 0,02 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.03.2022 | | 1.340 | 1.395 | 0,10 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.11.2024 | | 1.100 | 941 | 0,07 |
| 8,250 % fällig am 15.04.2025 | | 1.900 | 1.644 | 0,12 |
| 10,750 % fällig am 01.04.2024 | | 500 | 468 | 0,03 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 17.05.2022 | € | 100 | 115 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 17.05.2029 | | 400 | 451 | 0,03 |
| 5,550 % fällig am 04.05.2020 | $ | 100 | 102 | 0,01 |
| 5,550 % fällig am 05.01.2026 | $ | 600 | $ 671 | 0,05 |
| 6,875 % fällig am 10.01.2039 | | 100 | 126 | 0,01 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 5,100 % fällig am 17.01.2024 | | 400 | 428 | 0,03 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.06.2028 | | 600 | 663 | 0,05 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 2,876 % fällig am 31.10.2022 | | 900 | 908 | 0,07 |
| 3,500 % fällig am 23.01.2025 | | 300 | 311 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 600 | 628 | 0,05 |
| 3,850 % fällig am 08.07.2024 | | 500 | 525 | 0,04 |
| **Greif, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.03.2027 | | 500 | 518 | 0,04 |
| **Hartford HealthCare Corp.** | | | | |
| 5,746 % fällig am 01.04.2044 | | 800 | 974 | 0,07 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.02.2027 | | 500 | 534 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 01.05.2023 | | 3.150 | 3.375 | 0,25 |
| 5,375 % fällig am 01.09.2026 | | 400 | 432 | 0,03 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2030 | | 200 | 207 | 0,01 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.04.2027 | | 100 | 104 | 0,01 |
| **Howard Hughes Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.03.2025 | | 400 | 415 | 0,03 |
| **Ingram Micro, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 10.08.2022 | | 500 | 505 | 0,04 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.08.2022 | | 4.300 | 4.686 | 0,34 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 800 | 863 | 0,06 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2022 | | 450 | 513 | 0,04 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.03.2025 | € | 1.000 | 1.177 | 0,09 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 03.06.2026 | $ | 1.600 | 1.618 | 0,12 |
| 7,250 % fällig am 15.08.2024 | | 400 | 395 | 0,03 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.02.2037 | | 600 | 722 | 0,05 |
| 6,950 % fällig am 15.01.2038 | | 1.900 | 2.439 | 0,18 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 5,300 % fällig am 01.12.2034 | | 300 | 340 | 0,02 |
| 7,750 % fällig am 15.01.2032 | | 1.800 | 2.466 | 0,18 |
| 7,800 % fällig am 01.08.2031 | | 2.300 | 3.095 | 0,22 |
| **L Brands, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.11.2035 | | 100 | 89 | 0,01 |
| **Marriott Ownership Resorts, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.09.2026 | | 250 | 269 | 0,02 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.03.2022 | | 400 | 447 | 0,03 |
| **Midcontinent Express Pipeline LLC** | | | | |
| 6,700 % fällig am 15.09.2019 | | 4.700 | 4.745 | 0,35 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 4,000 % fällig am 23.07.2025 | | 1.600 | 1.715 | 0,12 |
| **National Fuel Gas Co.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 15.07.2025 | | 600 | 649 | 0,05 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 25.01.2022 | | 500 | 541 | 0,04 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | € | 5.400 | 6.677 | 0,49 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | $ | 300 | 319 | 0,02 |
| **NextEra Energy Operating Partners LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.07.2024 | | 500 | 504 | 0,04 |
| **NGPL PipeCo LLC** | | | | |
| 7,768 % fällig am 15.12.2037 | | 200 | 255 | 0,02 |
| **Oxford Finance LLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.12.2022 | | 300 | 309 | 0,02 |
| **Pitney Bowes, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.09.2020 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.12.2026 | | 300 | 320 | 0,02 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.12.2029 (c) | | 200 | 201 | 0,01 |
| **QEP Resources, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.03.2026 | | 1.100 | 1.040 | 0,08 |
| **Quicken Loans, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | | 4.500 | 4.494 | 0,33 |

| BESCHREIBUNG | PAR (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **QVC, Inc.** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2023 | $ 100 | $ 102 | 0,01 |
| 5,450 % fällig am 15.08.2034 | 1.600 | 1.578 | 0,11 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | 4.678 | 5.233 | 0,38 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | 181 | 208 | 0,01 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2020 | 8.740 | 8.926 | 0,65 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | 200 | 219 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | 1.900 | 1.974 | 0,14 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | 600 | 654 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | 8.700 | 9.751 | 0,71 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | 2.700 | 3.005 | 0,22 |
| 5,875 % fällig am 30.06.2026 | 1.200 | 1.372 | 0,10 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | 2.000 | 2.155 | 0,16 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | 1.300 | 1.427 | 0,10 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2026 | 2.200 | 2.415 | 0,18 |
| **Sprint Corp.** | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | 900 | 959 | 0,07 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | |
| 5,152 % fällig am 20.09.2029 | 2.100 | 2.168 | 0,16 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | 1.450 | 1.443 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2023 | 100 | 103 | 0,01 |
| **Sunoco LP** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2023 | 200 | 205 | 0,01 |
| **Talen Energy Supply LLC** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 (c) | 100 | 100 | 0,01 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | 700 | 711 | 0,05 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.11.2040 | 1.700 | 1.842 | 0,13 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2039 | 100 | 116 | 0,01 |
| **Toll Brothers Finance Corp.** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.03.2027 | 2.000 | 2.108 | 0,15 |
| **VEREIT Operating Partnership LP** | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | 200 | 205 | 0,01 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 4,125 % fällig am 16.03.2027 | 1.200 | 1.306 | 0,09 |
| 4,672 % fällig am 15.03.2055 | 521 | 592 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 16.03.2037 | 1.300 | 1.557 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 16.03.2047 | 400 | 503 | 0,04 |
| **Vistra Energy Corp.** | | | |
| 7,375 % fällig am 01.11.2022 | 838 | 870 | 0,06 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | |
| 2,400 % fällig am 22.05.2020 | 4.000 | 3.992 | 0,29 |
| 4,000 % fällig am 12.11.2021 | 1.600 | 1.652 | 0,12 |
| **Washington Prime Group LP** | | | |
| 5,950 % fällig am 15.08.2024 | 1.400 | 1.332 | 0,10 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | |
| 2,625 % fällig am 22.07.2022 | 100 | 101 | 0,01 |
| 3,300 % fällig am 09.09.2024 | 200 | 207 | 0,01 |
| 3,465 % fällig am 11.02.2022 | 300 | 302 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 08.03.2022 | 200 | 206 | 0,01 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | 6.000 | 6.212 | 0,45 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | |
| 4,500 % fällig am 29.04.2022 | 817 | 833 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 29.04.2025 | 1.470 | 1.520 | 0,11 |
| | | 207.368 | 15,09 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | |
| **California Resources Corp.** | | | |
| 7,152 % fällig am 31.12.2022 | 500 | 478 | 0,03 |
| **CenturyLink, Inc.** | | | |
| 5,152 % fällig am 31.01.2025 | 6.501 | 6.357 | 0,46 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | |
| 4,330 % fällig am 30.04.2025 | 6.438 | 6.437 | 0,47 |
| **CommScope, Inc.** | | | |
| 5,652 % fällig am 06.04.2026 | 500 | 500 | 0,04 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 4,410 % fällig am 07.09.2023 | 5.946 | 5.921 | 0,43 |
| **Envision Healthcare Corp.** | | | |
| 6,152 % fällig am 10.10.2025 | 796 | 693 | 0,05 |
| **Grifols Worldwide Operations USA, Inc.** | | | |
| 4,635 % fällig am 31.01.2025 | $ 5.374 | $ 5.365 | 0,39 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 4,330 % fällig am 13.03.2025 | 6.443 | 6.456 | 0,47 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | |
| 4,154 % fällig am 25.10.2023 | 5.185 | 5.194 | 0,38 |
| **Ineos Finance LLC** | | | |
| 2,500 % fällig am 31.03.2024 | € 6.705 | 7.612 | 0,55 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | |
| TBD % fällig am 21.05.2026 | $ 200 | 200 | 0,01 |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | |
| 4,152 % fällig am 27.03.2025 | 902 | 897 | 0,07 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | |
| 4,652 % fällig am 22.02.2024 | 4.800 | 4.767 | 0,35 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | |
| 4,412 % fällig am 04.10.2023 | 2.161 | 2.143 | 0,16 |
| **VFH Parent LLC** | | | |
| 6,044 % fällig am 01.03.2026 | 967 | 970 | 0,07 |
| **Virgin Media Bristol LLC** | | | |
| 4,894 % fällig am 15.01.2026 | 6.600 | 6.584 | 0,48 |
| **Ziggo Secured Finance BV** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.04.2025 | € 7.900 | 8.992 | 0,65 |
| **Ziggo Secured Finance Partnership** | | | |
| 4,894 % fällig am 15.04.2025 | $ 3.100 | 3.042 | 0,22 |
| | | 72.608 | 5,28 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 8,084 % fällig am 15.02.2050 | 1.500 | 2.612 | 0,19 |
| **Erie Tobacco Asset Securitization Corp., New York Revenue Bonds, Series 2005** | | | |
| 6,000 % fällig am 01.06.2028 | 110 | 110 | 0,01 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 6,630 % fällig am 01.02.2035 | 400 | 462 | 0,03 |
| 6,725 % fällig am 01.04.2035 | 220 | 255 | 0,02 |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035 | 350 | 413 | 0,03 |
| **Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 6,655 % fällig am 01.04.2057 | 991 | 1.297 | 0,09 |
| **San Diego Redevelopment Agency, California Tax Allocation Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,625 % fällig am 01.09.2030 | 100 | 106 | 0,01 |
| **Texas Public Finance Authority Revenue Notes, Series 2014** | | | |
| 8,250 % fällig am 01.07.2024 | 265 | 266 | 0,02 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 7,467 % fällig am 01.06.2047 | 140 | 141 | 0,01 |
| **Tobacco Settlement Financing Corp., Virginia Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 6,706 % fällig am 01.06.2046 | 95 | 90 | 0,01 |
| | | 5.752 | 0,42 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,804 % fällig am 25.01.2037 ^ | 167 | 136 | 0,01 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 4,648 % fällig am 20.01.2047 ^ | 116 | 112 | 0,01 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 3,297 % fällig am 26.11.2046 | 338 | 341 | 0,03 |
| 6,227 % fällig am 26.08.2036 | 2.801 | 1.904 | 0,14 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 4,910 % fällig am 25.02.2036 | 22 | 21 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 2,844 % fällig am 25.04.2035 | 81 | 82 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,648 % fällig am 25.10.2046 ^ | 49 | 44 | 0,00 |
| 4,820 % fällig am 25.10.2035 | 167 | 172 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,593 % fällig am 20.05.2046 ^ | 505 | 427 | 0,03 |
| 2,804 % fällig am 25.07.2036 ^ | 5 | 4 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.04.2036 | 790 | 401 | 0,03 |
| 3,984 % fällig am 25.01.2036 | 20 | 21 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | 202 | 167 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | $ 1.199 | $ 821 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | 315 | 263 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,674 % fällig am 25.04.2046 | 2.116 | 965 | 0,07 |
| 3,464 % fällig am 25.04.2046 ^ | 21 | 11 | 0,00 |
| 3,865 % fällig am 25.03.2037 ^ | 22 | 20 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | 572 | 447 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | 98 | 68 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | 183 | 128 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 3,500 % fällig am 26.04.2038 | 553 | 558 | 0,04 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 4,623 % fällig am 25.09.2035 | 33 | 33 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,653 % fällig am 20.10.2045 | 782 | 781 | 0,06 |
| 2,700 % fällig am 19.11.2035 | 13 | 12 | 0,00 |
| 2,830 % fällig am 19.05.2035 | 332 | 323 | 0,02 |
| 2,870 % fällig am 19.06.2035 | 9 | 9 | 0,00 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.11.2035 | 2.272 | 2.075 | 0,15 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.03.2037 ^ | 148 | 140 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | 28 | 27 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.07.2047 | 104 | 89 | 0,01 |
| 3,432 % fällig am 25.06.2037 ^ | 21 | 20 | 0,00 |
| 4,335 % fällig am 25.12.2036 ^ | 4 | 4 | 0,00 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 ^ | 247 | 253 | 0,02 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 3,064 % fällig am 25.11.2029 | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,103 % fällig am 25.05.2036 | 9 | 8 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,184 % fällig am 25.03.2036 ^ | 66 | 58 | 0,00 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | |
| 4,714 % fällig am 25.08.2035 | 4 | 4 | 0,00 |
| **Nomura Resecuritization Trust** | | | |
| 5,363 % fällig am 26.02.2037 | 914 | 917 | 0,07 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 2,604 % fällig am 25.05.2047 | 142 | 139 | 0,01 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.06.2037 | 454 | 440 | 0,03 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 2,604 % fällig am 25.05.2036 | 879 | 845 | 0,06 |
| 2,614 % fällig am 25.09.2047 ^ | 1.020 | 1.045 | 0,08 |
| **SunTrust Alternative Loan Trust** | | | |
| 3,054 % fällig am 25.12.2035 ^ | 6 | 5 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 3,654 % fällig am 25.06.2037 ^ | 31 | 30 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 3,704 % fällig am 25.11.2042 | 17 | 16 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 4,313 % fällig am 25.09.2036 ^ | 156 | 75 | 0,01 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,934 % fällig am 25.04.2036 | 3 | 3 | 0,00 |
| 5,085 % fällig am 25.03.2035 | 131 | 135 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | 246 | 250 | 0,02 |
| | | 14.851 | 1,08 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 11.300 | 11.380 | 0,83 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 84.900 | 86.789 | 6,32 |
| | | 98.169 | 7,15 |
| Summe USA | | 463.561 | 33,74 |
| **VENEZUELA** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | 1.600 | 256 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Venezuela Government International Bond** | | | |
| 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^ | 241 | 65 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^ | 1.528 | 405 | 0,03 |

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

| BESCHREIBUNG | | PAR (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 ^ | $ | 1.900 | $ 506 | 0,04 |
| | | | 976 | 0,07 |
| Summe Venezuela | | | 1.232 | 0,09 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Bank of Montreal** | | | | |
| 1,787 % fällig am 22.07.2019 | CAD | 400 | 306 | 0,02 |
| 1,797 % fällig am 19.07.2019 | | 300 | 229 | 0,02 |
| 1,800 % fällig am 24.07.2019 | | 100 | 76 | 0,01 |
| 1,802 % fällig am 12.07.2019 | | 600 | 459 | 0,03 |
| 1,802 % fällig am 26.07.2019 | | 300 | 229 | 0,02 |
| 1,806 % fällig am 31.07.2019 | | 2.400 | 1.834 | 0,13 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | |
| 1,773 % fällig am 22.07.2019 | | 700 | 535 | 0,04 |
| 1,775 % fällig am 23.07.2019 | | 200 | 153 | 0,01 |
| 1,775 % fällig am 25.07.2019 | | 200 | 153 | 0,01 |
| 1,785 % fällig am 22.07.2019 | | 700 | 535 | 0,04 |
| **C.I.B.C.** | | | | |
| 1,802 % fällig am 12.07.2019 | | 600 | 459 | 0,03 |
| **HSBC Bank Canada** | | | | |
| 1,827 % fällig am 24.07.2019 | | 600 | 459 | 0,03 |
| 1,828 % fällig am 25.07.2019 | | 300 | 229 | 0,02 |
| 1,828 % fällig am 26.07.2019 | CAD | 400 | $ 306 | 0,02 |
| 1,854 % fällig am 11.07.2019 | | 1.100 | 841 | 0,06 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 1,765 % fällig am 02.07.2019 | | 900 | 689 | 0,05 |
| 1,773 % fällig am 22.07.2019 | | 500 | 382 | 0,03 |
| 1,777 % fällig am 25.07.2019 | | 300 | 229 | 0,02 |
| 1,777 % fällig am 26.07.2019 | | 1.100 | 841 | 0,06 |
| 1,795 % fällig am 31.07.2019 | | 1.400 | 1.070 | 0,08 |
| 1,801 % fällig am 11.07.2019 | | 500 | 382 | 0,03 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 1,765 % fällig am 02.07.2019 | | 1.500 | 1.148 | 0,08 |
| 1,787 % fällig am 22.07.2019 | | 600 | 459 | 0,03 |
| 1,788 % fällig am 24.07.2019 | | 700 | 535 | 0,04 |
| 1,792 % fällig am 16.07.2019 | | 100 | 76 | 0,01 |
| 1,792 % fällig am 26.07.2019 | | 200 | 153 | 0,01 |
| 1,795 % fällig am 19.07.2019 | | 500 | 382 | 0,03 |
| | | | 13.149 | 0,96 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (j)** | | | | |
| | | | 95.186 | 6,93 |
| **GREECE TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,556 % fällig am 04.10.2019 (e)(f) | € | 1.500 | 1.707 | 0,13 |
| 0,587 % fällig am 04.10.2019 (e)(f) | € | 5.800 | $ 6.600 | 0,48 |
| 0,618 % fällig am 30.08.2019 (e)(f) | | 2.900 | 3.301 | 0,24 |
| 0,729 % fällig am 30.08.2019 (e)(f) | | 2.200 | 2.505 | 0,18 |
| | | | 14.113 | 1,03 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 122.448 | 8,92 |

| BESCHREIBUNG | ANZAHL | | |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)** | 2.594.290 | 25.982 | 1,89 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | $ 1.426.127 | 103,82 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09/2019 | 119 | $ 24 | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 150 | (211) | (0,02) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 164 | (298) | (0,02) |
| | | | | $ (485) | (0,04) |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures | $ 126,500 | 26.07.2019 | 87 | $ (22) | $ (12) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 87 | (20) | (23) | 0,00 |
| | | | | $ (42) | $ (35) | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | **$ (520)** | **(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(1)**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag(2) | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 3.800 | $ 17 | 0,00 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 1,000 | 20.12.2020 | € 5.900 | (352) | (0,03) |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 1,000 | 20.12.2021 | 1.600 | (198) | (0,01) |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.06.2023 | $ 5.100 | (214) | (0,02) |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2022 | 1.100 | (73) | (0,01) |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2023 | 700 | (2) | 0,00 |
| Frontier Communications Corp. | 5,000 | 20.06.2020 | 1.000 | (172) | (0,01) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 3.800 | 209 | 0,02 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 700 | 5 | 0,00 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 5.200 | 68 | 0,01 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2023 | 400 | 1 | 0,00 |
| Navient Corp. | 5,000 | 20.12.2022 | $ 200 | 1 | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A.U. | 1,000 | 20.12.2023 | € 4.600 | 118 | 0,01 |
| Telefonica Emisiones S.A.U. | 1,000 | 20.06.2024 | 1.600 | 10 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.06.2024 | 300 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ (581) | (0,04) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 111.700 | $ 1.788 | 0,13 |
| CDX.HY-32 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2024 | 86.800 | 1.274 | 0,09 |
| CDX.IG-31 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2023 | 4.000 | 48 | 0,00 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 86.600 | 329 | 0,03 |
| | | | | $ 3.439 | 0,25 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 21.12.2026 | $ 31.500 | $ (1.224) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 20.06.2023 | 14.800 | (756) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 21.000 | (1.989) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 21.12.2046 | 8.700 | (634) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 22.300 | (3.977) | (0,29) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2023 | 58.300 | (3.358) | (0,24) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 4.300 | (320) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2021 | 219.900 | (1.859) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 11.300 | (124) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2028 | 18.400 | (1.975) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 4.900 | (5) | 0,00) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2039 | 1.700 | (195) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 8.500 | (1.938) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2049 | 2.400 | (305) | (0,02) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.09.2021 | € 58.100 | (380) | (0,03) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2024 | 18.600 | (90) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | 54.900 | (1.248) | (0,09) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 18.12.2029 | 2.200 | (24) | 0,00 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | 47.800 | (1.868) | (0,14) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.12.2049 | 10.700 | (75) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2024 | £ 7.700 | (9) | 0,00) |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | 15.800 | (376) | (0,03) |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2029 | 6.900 | (328) | (0,02) |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 2.305 | (237) | (0,02) |
| | | | | | $ (23.294) | (1,70) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (20.436)** | **(1,49)** |

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

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

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

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 % | 21.08.2019 | 2.700 | $ (3) | $ (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 3.700 | (3) | (1) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 4.800 | (8 | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 10.800 | (18) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 1.000 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 3.800 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 2.900 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 18.09.2019 | 7.700 | (14) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 4.100 | (9) | (1) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 14.000 | (26) | (5) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 2.700 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 3.100 | (5) | (1) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 1.200 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 3.500 | (6) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,900 | 17.06.2020 | 18.700 | (17) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 5.700 | (6) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 2.000 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 5.200 | (10) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 12.200 | (20) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 3,000 | 17.06.2020 | 18.700 | (19) | (4) | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JLN | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 % | 18.09.2019 | 7.100 | $ (14) | $ (3) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 7.200 | (12) | (2) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 5.600 | (10) | (1) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 2.500 | (3) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (217) | $ (38) | 0,00 |

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,650 % | 12.07.2019 | 13.600 | $ (25) | $ (18) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,000 | 12.07.2019 | 13.600 | (25) | (3) | 0,00 |
| FBF | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,130 | 05.07.2019 | 7.200 | (19) | (106) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,640 | 19.07.2019 | 13.500 | (28) | (23) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,000 | 19.07.2019 | 13.500 | (24) | (5) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (121) | $ (155) | (0,01) |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 400 | $ (5) | $ 5 | $ 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 100 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| BRC | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 2.800 | (137) | 129 | (8) | 0,00 |
| | Kazakhstan Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 2.500 | (192) | 223 | 31 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 1.490 | (59) | 42 | (17) | 0,00 |
| CBK | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 300 | (11) | 4 | (7) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.000 | (17) | 12 | (5) | 0,00 |
| GST | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 200 | (7) | 2 | (5) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 1.400 | (11) | 19 | 8 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 1.610 | (63) | 44 | (19) | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 800 | (19) | 28 | 9 | 0,00 |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (3) | 2 | (1) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 600 | (17) | 3 | (14) | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 17.100 | (140) | 125 | (15) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 1.600 | (26) | 26 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 2.200 | (35) | 24 | (11) | 0,00 |
| JPM | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 400 | (19) | 22 | 3 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 300 | (3) | 3 | 0 | 0,00 |
| UAG | Avolon Holdings Ltd. | 5,000 | 01.07.2020 | 300 | 18 | (6) | 12 | 0,00 |
| | | | | | $ (748) | $ 709 | $ (39) | 0,00 |

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

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

**TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES**

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 13.300 | 20.12.2019 | $ (82) | $ 222 | $ 140 | 0,01 |
| CBK | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 1.100 | 20.09.2019 | (7) | 57 | 50 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (89) | $ 279 | $ 190 | 0,01 |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 251.882 | $ 281.446 | $ 0 | $ (5.399) | $ (5.399) | (0,39) |
| | 07/2019 | $ 284.737 | € 250.580 | 624 | 0 | 624 | 0,04 |
| | 08/2019 | € 242.132 | $ 275.860 | 0 | (585) | (585) | (0,04) |
| | 08/2019 | $ 1.697 | BRL 6.564 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH 46.977 | $ 6.774 | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD 9.256 | 6.762 | 0 | (87) | (87) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ 2.545 | KRW 2.943.103 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | 3.184 | TWD 98.109 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | CAD | 2.400 | $ | 1.821 | $ 0 | $ (15) | $ (15) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 2.565 | | 2.877 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 96 | ARS | 4.841 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 787 | € | 702 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 102.047 | £ | 80.465 | 360 | 0 | 360 | 0,03 |
| | 08/2019 | ARS | 9.107 | $ | 204 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 79.400 | | 100.861 | 0 | (348) | (348) | (0,03) |
| | 09/2019 | KRW | 8.025.937 | | 6.770 | 0 | (179) | (179) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 6.773 | CNH | 46.588 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 3.750 | TWD | 115.438 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | | 3.317 | £ | 2.618 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.685 | IDR | 24.050.005 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | ARS | 178.436 | $ | 3.660 | 0 | (374) | (374) | (0,03) |
| | 07/2019 | € | 1.932 | | 2.194 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 108.800 | | 999 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.071 | AUD | 1.538 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.988 | £ | 1.568 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | CAD | 2.300 | $ | 1.755 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 7.364 | € | 6.541 | 85 | 0 | 85 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 9.605 | £ | 7.557 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.718 | RUB | 174.506 | 45 | (1) | 44 | 0,00 |
| | 08/2019 | RUB | 428.495 | $ | 6.508 | 0 | (228) | (228) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ | 3.662 | BRL | 14.177 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 3.470 | IDR | 49.568.950 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 3.261 | MXN | 63.394 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | BRL | 3.568 | $ | 893 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 222 | | 252 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.494 | ARS | 173.595 | 431 | 0 | 431 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 24 | £ | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.711 | BRL | 6.626 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 6.800 | SGD | 9.220 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 60.074 | $ | 3.068 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 123.293 | | 3.938 | 0 | (67) | (67) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | CAD | 2.500 | | 1.897 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 2.093 | | 2.360 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 734 | € | 649 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.643 | IDR | 23.466.969 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 4.389 | KRW | 5.070.203 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 39.613 | $ | 1.262 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | $ | 4.829 | RUB | 305.048 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CAD | 500 | $ | 380 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| RBC | 09/2019 | $ | 0 | KRW | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | CAD | 5.600 | $ | 4.271 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.026 | BRL | 3.923 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | BRL | 3.923 | $ | 1.023 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 356 | | 88 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 2.800 | | 2.103 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 90.640 | | 114.722 | 0 | (635) | (635) | (0,05) |
| | 07/2019 | $ | 5.622 | RUB | 372.865 | 279 | 0 | 279 | 0,02 |
| | 11/2019 | TWD | 49.428 | $ | 1.579 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | CAD | 700 | | 531 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 400 | | 304 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | $ | 1.011 | ¥ | 108.800 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 108.800 | $ | 1.013 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.990 | $ (8.287) | $ (6.297) | (0,46) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 165.580 | $ | 188.165 | $ 0 | $ (397) | $ (397) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ | 188.645 | € | 165.580 | 400 | 0 | 400 | 0,03 |
| BPS | 07/2019 | € | 159.892 | $ | 181.796 | 0 | (289) | (289) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 29.808 | € | 26.345 | 198 | (5) | 193 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 182.071 | | 159.726 | 287 | 0 | 287 | 0,02 |
| BRC | 07/2019 | | 176.018 | | 157.386 | 3.214 | 0 | 3.214 | 0,23 |
| CBK | 07/2019 | € | 165.906 | $ | 188.552 | 0 | (382) | (382) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 1.420 | € | 1.251 | 6 | (1) | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 188.662 | | 165.580 | 383 | 0 | 383 | 0,03 |
| GLM | 07/2019 | € | 753 | $ | 845 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4.683 | € | 4.195 | 94 | 0 | 94 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | | 175.989 | | 157.386 | 3.243 | 0 | 3.243 | 0,24 |
| RBC | 07/2019 | | 313 | | 276 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | € | 1.178 | $ | 1.332 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 10.933 | | 12.327 | 0 | (125) | (125) | (0,01) |
| SSB | 07/2019 | | 247 | | 279 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 46 | € | 41 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 175.990 | | 157.386 | 3.242 | 0 | 3.242 | 0,24 |
| | | | | | | $ 11.069 | $ (1.222) | $ 9.847 | 0,72 |

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

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | £ 33 | $ 41 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 9.913 | £ 7.863 | 95 | 0 | 95 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | £ 158.326 | $ 200.814 | 0 | (687) | (687) | (0,05) |
| | 07/2019 | $ 384 | £ 304 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | 201.005 | 158.235 | 692 | 0 | 692 | 0,05 |
| CBK | 07/2019 | £ 157.606 | $ 200.253 | 0 | (332) | (332) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ 197.409 | £ 155.802 | 880 | 0 | 880 | 0,06 |
| | 08/2019 | 200.560 | 157.606 | 337 | 0 | 337 | 0,02 |
| GLM | 07/2019 | £ 6.039 | $ 7.634 | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 114 | 144 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | $ 197.199 | £ 155.802 | 1.091 | 0 | 1.091 | 0,08 |
| SSB | 07/2019 | 195.612 | 154.812 | 1.418 | 0 | 1.418 | 0,10 |
| | | | | $ 4.516 | $ (1.072) | $ 3.444 | 0,25 |
| | | | | | **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 6.952** | **0,51** |
| | | | | | **Summe Anlagen** | **$ 1.412.123** | **102,80** |
| | | | | | **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (38.407)** | **(2,80)** |
| | | | | | **Nettovermögen** | **$ 1.373.716** | **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.**

**^ Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Reines Kapitalwertpapier.**

**(c) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(d) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(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.**

**Barmittel in Höhe von USD 35.918 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 5.840 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,440 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 26.000 | U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2047 | $ (26.562) | $ 26.000 | $ 26.005 | 1,89 |
| | 2,700 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 4.000 | U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2047 | (4.087) | 4.000 | 4.001 | 0,29 |
| | 2,800 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 12.900 | U.S. Treasury Bonds 3,750 % fällig am 15.11.2043 | (13.250) | 12.900 | 12.903 | 0,95 |
| BPG | 2,550 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 42.200 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 | (43.065) | 42.200 | 42.209 | 3,07 |
| FICC | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 10.086 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | (10.291) | 10.086 | 10.088 | 0,73 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (97.255)** | **$ 95.186** | **$ 95.206** | **6,93** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 134.429 | $ 1.286.710 | $ 4.988 | $ 1.426.127 |
| Finanzderivate[3] | (520) | (13.496) | 12 | (14.004) |
| **Summen** | **$ 133.909** | **$ 1.273.214** | **$ 5.000** | **$ 1.412.123** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 127.385 | $ 1.167.389 | $ 11.547 | $ 1.306.321 |
| Finanzderivate[3] | 297 | (16.914) | 15 | (16.602) |
| **Summen** | **$ 127.682** | **$ 1.150.475** | **$ 11.562** | **$ 1.289.719** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (5.421) | $ 5.250 | $ (171) |
| BPS | (12) | 590 | 578 |
| BRC | 3.371 | (3.210) | 161 |
| CBK | 555 | (170) | 385 |
| CKL | (5) | 0 | (5) |
| DUB | (2) | (10) | (12) |
| FBF | (106) | 0 | (106) |
| GLM | (73) | 0 | (73) |
| GST | (22) | 0 | (22) |
| HUS | 313 | 0 | 313 |
| JLN | (5) | 0 | (5) |
| JPM | (57) | 0 | (57) |
| MSB | (2) | 0 | (2) |
| MYI | 3.240 | (2.950) | 290 |
| RBC | 1 | 0 | 1 |
| RYL | (26) | 0 | (26) |
| SCX | 539 | (240) | 299 |
| SSB | 1.413 | (570) | 843 |
| TOR | 3.239 | (3.060) | 179 |
| UAG | 12 | 0 | 12 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 69,58 | 61,46 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 33,50 | 36,93 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,74 | 4,15 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,04) | 0,02 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,49) | (1,14) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,51 | (0,18) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 1,47 | 1,53 |
| Australien | 0,02 | 0,01 |
| Österreich | 0,06 | 0,00 |
| Bermuda | 0,35 | 0,34 |
| Brasilien | 0,81 | 0,75 |
| Kanada | 0,21 | 0,14 |
| Cayman-Inseln | 3,69 | 2,94 |
| Chile | 0,05 | 0,05 |
| China | 0,04 | 0,05 |
| Kolumbien | 0,75 | 0,70 |
| Costa Rica | 0,02 | 0,06 |
| Kroatien | 0,07 | 0,03 |
| Curacao | 0,51 | 0,53 |
| Dänemark | 0,00 | 0,12 |
| Dominikanische Republik | 0,35 | 0,38 |
| Ecuador | 0,51 | 0,41 |
| Ägypten | 0,57 | 0,19 |
| Frankreich | 2,48 | 2,09 |
| Deutschland | 2,81 | 2,11 |
| Ghana | 0,18 | 0,00 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,36 | 0,21 |
| Hongkong | 0,04 | 0,05 |
| Indien | 0,15 | 0,12 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Indonesien | 1,17 | 1,45 |
| Irland | 9,28 | 9,46 |
| Insel Man | 0,06 | 0,00 |
| Italien | 2,54 | 2,70 |
| Japan | 0,50 | 0,86 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,90 | 1,45 |
| Kasachstan | 0,41 | 0,41 |
| Kenia | 0,09 | 0,00 |
| Luxemburg | 3,73 | 4,22 |
| Mazedonien | 0,03 | 0,03 |
| Mexiko | 1,61 | 2,05 |
| Niederlande | 3,87 | 5,12 |
| Nigeria | 0,02 | 0,02 |
| Norwegen | 0,11 | 0,00 |
| Oman | 0,42 | 0,43 |
| Panama | 0,39 | 0,38 |
| Polen | 0,43 | 0,00 |
| Katar | 1,06 | 1,03 |
| Rumänien | 0,28 | 0,28 |
| Russland | 0,66 | 0,06 |
| Saudi-Arabien | 0,57 | 0,57 |
| Senegal | 0,06 | 0,06 |
| Südafrika | 0,69 | 0,17 |
| Spanien | 1,33 | 1,54 |
| Schweden | 0,02 | 0,00 |
| Schweiz | 1,64 | 1,64 |
| Trinidad und Tobago | 0,05 | 0,05 |
| Tunesien | 0,03 | 0,00 |
| Türkei | 2,19 | 2,48 |
| Ukraine | 1,36 | 1,28 |
| Großbritannien | 8,18 | 9,95 |
| Vereinigte Staaten | 33,74 | 34,76 |
| Venezuela | 0,09 | 0,07 |
| Kurzfristige Instrumente | 8,92 | 5,32 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 1,89 | 1,89 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,04) | 0,02 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,04) | (0,09) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,25 | (0,37) |
| Zinsswaps | (1,70) | (0,68) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,02) |
| Zinsswapoption | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | (0,12) |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,01 | (0,02) |
| Devisenterminkontrakte | (0,46) | 0,02 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,97 | (0,04) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (2,80) | (1,24) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | | |
| 6,904 % - 9,000 % fällig am 17.11.2025 | $ | 5.871 | $ | 5.851 | 0,15 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | | |
| 5,152 % fällig am 22.12.2024 | | 2.962 | | 2.912 | 0,07 |
| **Delos Finance SARL** | | | | | |
| 4,080 % fällig am 06.10.2023 | | 3.833 | | 3.835 | 0,09 |
| **Financial & Risk U.S. Holdings, Inc.** | | | | | |
| 3,773 % - 4,000 % fällig am 01.10.2025 | € | 1.990 | | 2.266 | 0,06 |
| **First Data Corp.** | | | | | |
| 4,404 % fällig am 08.07.2022 | $ | 794 | | 794 | 0,02 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | | |
| 4,154 % fällig am 25.10.2023 | | 4.774 | | 4.782 | 0,12 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | | |
| 4,938 % fällig am 02.02.2024 | | 1.985 | | 1.958 | 0,05 |
| **Starfruit Finco BV** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.10.2025 | € | 5.800 | | 6.640 | 0,17 |
| **State Of Qatar** | | | | | |
| 2,983 % fällig am 21.12.2020 | $ | 5.000 | | 4.987 | 0,12 |
| | | | | 34.025 | 0,85 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | | |
| 3,300 % fällig am 23.01.2023 | | 2.450 | | 2.473 | 0,06 |
| 3,950 % fällig am 01.02.2022 | | 250 | | 257 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 16.12.2021 | | 1.000 | | 1.039 | 0,03 |
| 4,450 % fällig am 01.10.2025 | | 3.900 | | 4.116 | 0,10 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | | 350 | | 361 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2021 | | 300 | | 315 | 0,01 |
| **AGFC Capital Trust** | | | | | |
| 4,347 % fällig am 15.01.2067 | | 2.500 | | 1.500 | 0,04 |
| **AIA Group Ltd.** | | | | | |
| 3,900 % fällig am 06.04.2028 | | 3.000 | | 3.192 | 0,08 |
| **Air Lease Corp.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.06.2021 | | 300 | | 305 | 0,01 |
| **Annington Funding PLC** | | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.07.2024 | € | 400 | | 467 | 0,01 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 13.200 | | 14.292 | 0,36 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | | |
| 3,470 % fällig am 01.06.2021 | | 9.200 | | 9.249 | 0,23 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2027 | | 3.600 | | 3.605 | 0,09 |
| 3,875 % fällig am 01.05.2023 | | 300 | | 310 | 0,01 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | | 300 | | 321 | 0,01 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (h)(j) | € | 4.800 | | 5.753 | 0,14 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (h)(j) | | 5.400 | | 6.331 | 0,16 |
| 8,875 % fällig am 14.04.2021 (h)(j) | | 200 | | 254 | 0,01 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (h)(j) | | 4.500 | | 5.400 | 0,14 |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 2,999 % fällig am 25.06.2022 | $ | 1.900 | | 1.906 | 0,05 |
| 3,419 % fällig am 20.12.2028 | | 329 | | 339 | 0,01 |
| 3,499 % fällig am 17.05.2022 | | 1.000 | | 1.020 | 0,03 |
| 3,550 % fällig am 05.03.2024 | | 2.200 | | 2.282 | 0,06 |
| 3,864 % fällig am 23.07.2024 | | 5.300 | | 5.570 | 0,14 |
| 4,125 % fällig am 22.01.2024 | | 5.050 | | 5.405 | 0,14 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (j) | | 3.700 | | 4.043 | 0,10 |
| 10,179 % fällig am 12.06.2021 | | 7.240 | | 8.197 | 0,21 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | | 3.000 | | 3.106 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (h)(j) | € | 200 | | 231 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (h)(j) | £ | 2.500 | | 3.322 | 0,08 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (h)(j) | € | 2.700 | | 3.332 | 0,08 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (h)(j) | $ | 2.300 | | 2.414 | 0,06 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.02.2024 | € | 1.100 | | 1.315 | 0,03 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 23.01.2027 | € | 2.400 | $ | 2.966 | 0,07 |
| 3,375 % fällig am 09.01.2025 | $ | 10.000 | | 10.182 | 0,26 |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | | 4.800 | | 5.205 | 0,13 |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 1.200 | | 1.288 | 0,03 |
| **Brown & Brown, Inc.** | | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2024 | | 7.500 | | 7.926 | 0,20 |
| **Citibank N.A.** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 23.07.2021 | | 2.000 | | 2.043 | 0,05 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | | |
| 3,200 % fällig am 21.10.2026 | | 1.500 | | 1.531 | 0,04 |
| 3,540 % fällig am 25.04.2022 | | 1.000 | | 1.009 | 0,03 |
| 3,668 % fällig am 24.07.2028 | | 4.600 | | 4.804 | 0,12 |
| 3,950 % fällig am 01.09.2023 | | 4.200 | | 4.280 | 0,11 |
| 3,980 % fällig am 20.03.2030 | | 5.000 | | 5.345 | 0,13 |
| 4,044 % fällig am 01.06.2024 | | 5.900 | | 6.240 | 0,16 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 19.01.2021 | | 800 | | 803 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 26.09.2023 | | 1.100 | | 1.161 | 0,03 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (h)(j) | € | 1.400 | | 1.768 | 0,04 |
| **Corp. Andina de Fomento** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.10.2021 (g) | MXN | 128.742 | | 6.623 | 0,17 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 9.300 | | 9.638 | 0,24 |
| 4,875 % fällig am 16.07.2025 (h) | € | 1.100 | | 1.242 | 0,03 |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (j) | $ | 5.500 | | 6.067 | 0,15 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 12.09.2025 | £ | 500 | | 632 | 0,02 |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | $ | 5.000 | | 5.159 | 0,13 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 3.550 | | 3.710 | 0,09 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | | 4.200 | | 4.572 | 0,11 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.02.2028 | | 8.100 | | 8.419 | 0,21 |
| 4,300 % fällig am 15.02.2029 | | 5.000 | | 5.408 | 0,14 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 4.000 | | 4.594 | 0,12 |
| 3,567 % fällig am 13.07.2020 | $ | 4.500 | | 4.472 | 0,11 |
| 3,875 % fällig am 12.02.2024 | £ | 3.500 | | 4.570 | 0,11 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | $ | 14.350 | | 14.553 | 0,36 |
| 5,000 % fällig am 14.02.2022 | | 5.100 | | 5.259 | 0,13 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 29.01.2020 | | 15.150 | | 15.120 | 0,38 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | € | 2.600 | | 3.235 | 0,08 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | $ | 805 | | 839 | 0,02 |
| **E*TRADE Financial Corp.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.06.2028 | | 7.500 | | 7.893 | 0,20 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (e) | € | 1.125 | | 1.241 | 0,03 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | | 700 | | 781 | 0,02 |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | | 1.400 | | 1.577 | 0,04 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | | 700 | | 845 | 0,02 |
| 3,157 % fällig am 04.08.2020 | $ | 600 | | 602 | 0,01 |
| 3,408 % fällig am 05.04.2021 | | 200 | | 197 | 0,00 |
| 3,600 % fällig am 28.03.2022 | | 500 | | 492 | 0,01 |
| 3,753 % fällig am 15.02.2023 | | 400 | | 389 | 0,01 |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 | | 2.400 | | 2.443 | 0,06 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | | |
| 3,550 % fällig am 08.07.2022 | | 5.700 | | 5.804 | 0,15 |
| 3,640 % fällig am 30.06.2022 | | 2.200 | | 2.200 | 0,05 |
| 4,147 % fällig am 14.01.2022 | | 400 | | 404 | 0,01 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 2,876 % fällig am 31.10.2022 | | 7.000 | | 7.060 | 0,18 |
| 3,200 % fällig am 23.02.2023 | | 3.800 | | 3.892 | 0,10 |
| 3,363 % fällig am 31.10.2022 | | 500 | | 500 | 0,01 |
| 3,688 % fällig am 15.05.2026 | | 800 | | 789 | 0,02 |
| 3,696 % fällig am 26.04.2022 | | 4.000 | | 4.034 | 0,10 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | | | |
| 3,460 % fällig am 02.03.2021 | | 7.600 | | 7.591 | 0,19 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 08.03.2021 | | 850 | | 863 | 0,02 |
| 3,520 % fällig am 18.05.2024 | | 2.300 | | 2.307 | 0,06 |
| 4,098 % fällig am 05.01.2022 | | 3.000 | | 3.067 | 0,08 |
| 4,300 % fällig am 08.03.2026 | $ | 700 | $ | 752 | 0,02 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029 | | 2.500 | | 2.736 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 04.07.2029 (h)(j) | € | 2.200 | | 2.637 | 0,07 |
| **IMMOFINANZ AG** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 27.01.2023 | | 3.000 | | 3.573 | 0,09 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 23.01.2020 | $ | 10.000 | | 9.998 | 0,25 |
| 2,750 % fällig am 23.06.2020 | | 1.800 | | 1.807 | 0,05 |
| 3,125 % fällig am 23.01.2025 | | 900 | | 926 | 0,02 |
| 3,220 % fällig am 01.03.2025 | | 6.100 | | 6.276 | 0,16 |
| 3,797 % fällig am 23.07.2024 | | 3.000 | | 3.148 | 0,08 |
| 3,900 % fällig am 15.07.2025 | | 800 | | 855 | 0,02 |
| 4,005 % fällig am 23.04.2029 | | 9.000 | | 9.716 | 0,24 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | | |
| 3,086 % fällig am 26.04.2021 | | 250 | | 251 | 0,01 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK | 108.100 | | 16.560 | 0,42 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | | |
| 12,000 % fällig am 16.12.2024 (h) | $ | 1.600 | | 1.949 | 0,05 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 4,050 % fällig am 16.08.2023 | | 2.100 | | 2.194 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 22.03.2028 | | 900 | | 957 | 0,02 |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (h)(j) | £ | 20.128 | | 27.953 | 0,70 |
| **LoanCore Capital Markets LLC** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.06.2020 | $ | 550 | | 548 | 0,01 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 3,922 % fällig am 11.09.2024 | | 4.300 | | 4.505 | 0,11 |
| **Morgan Stanley** | | | | | |
| 3,095 % fällig am 10.02.2021 | | 2.000 | | 2.003 | 0,05 |
| 3,125 % fällig am 23.01.2023 | | 1.200 | | 1.228 | 0,03 |
| 3,249 % fällig am 10.06.2022 | | 4.800 | | 4.807 | 0,12 |
| 3,522 % fällig am 22.07.2022 | | 3.000 | | 3.020 | 0,08 |
| 3,737 % fällig am 24.04.2024 | | 1.300 | | 1.356 | 0,03 |
| 3,772 % fällig am 20.01.2022 | | 400 | | 404 | 0,01 |
| 3,772 % fällig am 24.01.2029 | | 900 | | 945 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 29.04.2024 | | 2.575 | | 2.731 | 0,07 |
| 3,981 % fällig am 24.10.2023 | | 2.600 | | 2.651 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 23.07.2025 | | 625 | | 670 | 0,02 |
| **Nationstar Mortgage Holdings, Inc.** | | | | | |
| 9,125 % fällig am 15.07.2026 | | 5.000 | | 5.088 | 0,13 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 3.500 | | 3.575 | 0,09 |
| 3,900 % fällig am 21.07.2025 | | 1.150 | | 1.212 | 0,03 |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | | 6.800 | | 7.119 | 0,18 |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | | 2.000 | | 2.089 | 0,05 |
| **Navient Corp.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 25.03.2021 | | 3.675 | | 3.831 | 0,10 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | | |
| 2,150 % fällig am 28.09.2020 | | 200 | | 199 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK | 150.000 | | 22.999 | 0,58 |
| **Nuveen Finance LLC** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.11.2024 | $ | 500 | | 539 | 0,01 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK | 121.000 | | 18.536 | 0,46 |
| **QBE Insurance Group Ltd.** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 24.11.2043 (j) | $ | 7.000 | | 7.711 | 0,19 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 18.000 | | 18.045 | 0,45 |
| **Regions Bank** | | | | | |
| 3,035 % fällig am 13.08.2021 | | 4.000 | | 3.998 | 0,10 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | | 1.100 | | 1.098 | 0,03 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 5.000 | | 5.174 | 0,13 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 7.000 | | 7.295 | 0,18 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | | 1.700 | | 1.817 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (h)(j) | | 1.500 | | 1.541 | 0,04 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (h)(j) | | 300 | | 324 | 0,01 |
| **Sagax AB** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | € | 2.200 | | 2.609 | 0,07 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | $ | 5.100 | | 5.155 | 0,13 |
| 4,796 % fällig am 15.11.2024 | | 8.800 | | 9.355 | 0,23 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (h)(j) | £ | 600 | $ | 813 | 0,02 |
| **Santander UK PLC** | | | | | |
| 3,140 % fällig am 01.06.2021 | $ | 1.700 | | 1.704 | 0,04 |
| **SL Green Operating Partnership LP** | | | | | |
| 3,505 % fällig am 16.08.2021 | | 3.400 | | 3.401 | 0,09 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | | 1.400 | | 1.491 | 0,04 |
| 6,125 % fällig am 15.05.2022 | | 750 | | 808 | 0,02 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 7.900 | | 8.512 | 0,21 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (h) | € | 1.900 | | 2.654 | 0,07 |
| **Synchrony Bank** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2022 | $ | 600 | | 605 | 0,02 |
| **Synchrony Financial** | | | | | |
| 5,150 % fällig am 19.03.2029 | | 11.500 | | 12.403 | 0,31 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | | |
| 3,589 % fällig am 07.04.2021 | | 5.575 | | 5.651 | 0,14 |
| **TP ICAP PLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | £ | 3.500 | | 4.563 | 0,11 |
| **U.S. Bank N.A.** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 24.07.2023 | $ | 6.800 | | 7.097 | 0,18 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 3,031 % fällig am 08.06.2020 | | 7.000 | | 7.038 | 0,18 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (j) | | 1.050 | | 1.178 | 0,03 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | | |
| 7,125 % fällig am 19.02.2020 (h)(j) | | 6.400 | | 6.535 | 0,16 |
| **UniCredit SpA** | | | | | |
| 6,497 % fällig am 14.01.2022 | | 6.200 | | 6.452 | 0,16 |
| 6,625 % fällig am 03.06.2023 (h)(j) | € | 2.000 | | 2.273 | 0,06 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 12.000 | | 13.718 | 0,34 |
| 9,250 % fällig am 03.06.2022 (h)(j) | € | 4.100 | | 5.233 | 0,13 |
| **Unigel Luxembourg S.A.** | | | | | |
| 10,500 % fällig am 22.01.2024 | $ | 3.200 | | 3.440 | 0,09 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.08.2022 | € | 600 | | 701 | 0,02 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 01.04.2022 | | 2.500 | | 2.873 | 0,07 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 10.07.2023 | £ | 2.400 | | 3.130 | 0,08 |
| **Waha Aerospace BV** | | | | | |
| 3,925 % fällig am 28.07.2020 | $ | 2.370 | | 2.380 | 0,06 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 2,600 % fällig am 22.07.2020 | | 1.725 | | 1.731 | 0,04 |
| 2,625 % fällig am 22.07.2022 | | 7.300 | | 7.356 | 0,18 |
| 3,000 % fällig am 22.04.2026 | | 2.100 | | 2.125 | 0,05 |
| 3,465 % fällig am 11.02.2022 | | 1.575 | | 1.585 | 0,04 |
| 3,813 % fällig am 31.10.2023 | | 500 | | 510 | 0,01 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | | | |
| 3,325 % fällig am 23.07.2021 | | 1.500 | | 1.515 | 0,04 |
| 3,550 % fällig am 14.08.2023 | | 9.900 | | 10.340 | 0,26 |
| | | | | 693.936 | 17,41 |

**INDUSTRIEWERTE**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **AbbVie, Inc.** | | | | | |
| 2,900 % fällig am 06.11.2022 | | 2.725 | | 2.745 | 0,07 |
| 3,200 % fällig am 06.11.2022 | | 1.800 | | 1.828 | 0,05 |
| 3,750 % fällig am 14.11.2023 | | 300 | | 313 | 0,01 |
| **Altice France S.A.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | € | 420 | | 498 | 0,01 |
| **Amazon.com, Inc.** | | | | | |
| 3,150 % fällig am 22.08.2027 | $ | 400 | | 421 | 0,01 |
| 4,050 % fällig am 22.08.2047 | | 5.500 | | 6.254 | 0,16 |
| **AMC Networks, Inc.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.08.2025 | | 1.700 | | 1.723 | 0,04 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 31.07.2022 | | 1.090 | | 1.124 | 0,03 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 400 | | 410 | 0,01 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 07.06.2022 | | 200 | | 203 | 0,01 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.07.2021 | | 200 | | 200 | 0,01 |
| 3,420 % fällig am 15.12.2023 | | 200 | | 197 | 0,00 |
| 3,875 % fällig am 15.12.2023 | | 400 | | 416 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028 | | 600 | | 633 | 0,02 |
| **BC Unlimited Liability Co.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2024 | $ | 2.000 | $ | 2.027 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2025 | | 600 | | 606 | 0,01 |
| **Braskem Netherlands Finance BV** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 10.01.2028 | | 2.700 | | 2.741 | 0,07 |
| **Broadcom Corp.** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.01.2023 | | 100 | | 99 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2022 | | 4.900 | | 4.915 | 0,12 |
| 3,625 % fällig am 15.01.2024 | | 400 | | 404 | 0,01 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.10.2022 | | 400 | | 403 | 0,01 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | | |
| 3,650 % fällig am 15.03.2023 | | 700 | | 721 | 0,02 |
| 3,950 % fällig am 15.03.2025 | | 4.600 | | 4.788 | 0,12 |
| **CCO Holdings LLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2028 | | 1.250 | | 1.280 | 0,03 |
| **Celgene Corp.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2025 | | 4.100 | | 4.396 | 0,11 |
| **Central Japan Railway Co.** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 23.02.2022 | | 600 | | 606 | 0,01 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,362 % fällig am 28.05.2021 | | 1.700 | | 1.699 | 0,04 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | | 2.800 | | 2.911 | 0,07 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 2.300 | | 2.418 | 0,06 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 6.350 | | 6.899 | 0,17 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 675 | | 794 | 0,02 |
| 6,484 % fällig am 23.10.2045 | | 1.100 | | 1.298 | 0,03 |
| 6,834 % fällig am 23.10.2055 | | 300 | | 357 | 0,01 |
| **Cigna Corp.** | | | | | |
| 3,060 % fällig am 17.09.2021 | | 300 | | 300 | 0,01 |
| **Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.** | | | | | |
| 9,250 % fällig am 15.02.2024 | | 3.300 | | 3.589 | 0,09 |
| **Cleveland-Cliffs, Inc.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2024 | | 1.300 | | 1.323 | 0,03 |
| **Comcast Corp.** | | | | | |
| 2,759 % fällig am 01.10.2021 | | 1.800 | | 1.808 | 0,05 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(c) | | 1.307 | | 627 | 0,02 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (9,000 % bar und 0,500 % PIK)** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(c) | | 553 | | 265 | 0,01 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.01.2028 | | 3.300 | | 3.476 | 0,09 |
| **Cornerstone Building Brands, Inc.** | | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.04.2026 | | 3.600 | | 3.519 | 0,09 |
| **CSN Resources S.A.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 21.07.2020 | | 174 | | 179 | 0,00 |
| **CVS Health Corp.** | | | | | |
| 3,083 % fällig am 09.03.2020 | | 1.500 | | 1.504 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 20.07.2022 | | 200 | | 206 | 0,01 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | | |
| 2,850 % fällig am 06.01.2022 | | 1.200 | | 1.207 | 0,03 |
| 3,400 % fällig am 22.02.2022 | | 1.400 | | 1.429 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 05.11.2021 | | 500 | | 513 | 0,01 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 2.200 | | 2.268 | 0,06 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 1.500 | | 1.618 | 0,04 |
| 6,020 % fällig am 15.06.2026 | | 900 | | 994 | 0,02 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 4.050 | | 4.075 | 0,10 |
| **Dometic Group AB** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.05.2026 | € | 1.000 | | 1.147 | 0,03 |
| **eBay, Inc.** | | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.07.2022 | $ | 300 | | 301 | 0,01 |
| **El Paso Natural Gas Co. LLC** | | | | | |
| 8,625 % fällig am 15.01.2022 | | 1.200 | | 1.375 | 0,03 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 7.300 | | 7.302 | 0,18 |
| 3,110 % fällig am 15.06.2020 | | 4.200 | | 4.212 | 0,11 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.06.2028 | | 4.000 | | 4.377 | 0,11 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.03.2022 | | 300 | | 322 | 0,01 |
| **EQT Corp.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.11.2021 | | 500 | | 523 | 0,01 |
| **Equifax, Inc.** | | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.08.2021 | $ | 700 | $ | 714 | 0,02 |
| **Exela Intermediate LLC** | | | | | |
| 10,000 % fällig am 15.07.2023 | | 1.550 | | 1.267 | 0,03 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.07.2024 | | 9.800 | | 9.899 | 0,25 |
| **GATX Corp.** | | | | | |
| 3,285 % fällig am 05.11.2021 | | 800 | | 797 | 0,02 |
| **General Mills, Inc.** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 17.10.2023 | | 500 | | 525 | 0,01 |
| **Glencore Finance Canada Ltd.** | | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.11.2021 | | 1.000 | | 1.049 | 0,03 |
| **HCA, Inc.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.05.2023 | | 100 | | 107 | 0,00 |
| 5,375 % fällig am 01.09.2026 | | 900 | | 972 | 0,02 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2022 | | 1.000 | | 1.093 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2020 | | 5.900 | | 6.036 | 0,15 |
| **Heathrow Finance PLC** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.03.2024 | £ | 6.400 | | 8.590 | 0,22 |
| **Huntsman International LLC** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.11.2022 | $ | 900 | | 952 | 0,02 |
| **Hyundai Capital America** | | | | | |
| 3,202 % fällig am 18.09.2020 | | 4.500 | | 4.504 | 0,11 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (c) | € | 3.200 | | 3.702 | 0,09 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.08.2023 | | 500 | | 581 | 0,01 |
| 2,125 % fällig am 12.02.2027 | | 2.500 | | 2.978 | 0,07 |
| 2,950 % fällig am 21.07.2020 | $ | 700 | | 702 | 0,02 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.10.2024 | | 2.000 | | 1.990 | 0,05 |
| **Interpublic Group of Cos., Inc.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.10.2021 | | 400 | | 411 | 0,01 |
| **Kinetic Concepts Inc.** | | | | | |
| 12,500 % fällig am 01.11.2021 | | 500 | | 552 | 0,01 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2035 | | 100 | | 105 | 0,00 |
| **MGM Resorts International** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | | 400 | | 419 | 0,01 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | | | |
| 3,922 % fällig am 01.06.2021 | | 700 | | 713 | 0,02 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | | |
| 4,640 % fällig am 06.02.2024 | | 7.500 | | 7.825 | 0,20 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.10.2021 | | 2.400 | | 2.379 | 0,06 |
| **Murphy Oil Corp.** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.08.2025 | | 3.300 | | 3.437 | 0,09 |
| **Mylan NV** | | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.06.2021 | | 1.800 | | 1.801 | 0,04 |
| **Mylan, Inc.** | | | | | |
| 4,200 % fällig am 29.11.2023 | | 300 | | 302 | 0,01 |
| **Newfield Exploration Co.** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.01.2026 | | 3.500 | | 3.840 | 0,10 |
| **NVR, Inc.** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.09.2022 | | 600 | | 623 | 0,02 |
| **NXP BV** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.09.2022 | | 700 | | 721 | 0,02 |
| 4,625 % fällig am 15.06.2022 | | 500 | | 525 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 01.06.2023 | | 600 | | 634 | 0,02 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2021 | | 500 | | 506 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 7.600 | | 8.043 | 0,20 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | | 100 | | 108 | 0,00 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 10.03.2025 | | 2.000 | | 2.100 | 0,05 |
| **Pernod Ricard S.A.** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.04.2021 | | 600 | | 634 | 0,02 |
| **QVC, Inc.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2023 | | 700 | | 711 | 0,02 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | | |
| 2,903 % fällig am 24.06.2022 | | 2.200 | | 2.193 | 0,05 |
| **RELX Capital, Inc.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 16.03.2023 | | 400 | | 413 | 0,01 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.06.2022 | | 200 | | 208 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Rockwell Collins, Inc.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.03.2024 | $ | 200 | $ 206 | 0,01 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | | 4.000 | 4.214 | 0,11 |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 1.700 | 1.766 | 0,04 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | | 1.600 | 1.685 | 0,04 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 7.800 | 8.491 | 0,21 |
| **Spectra Energy Partners LP** | | | | |
| 3,179 % fällig am 05.06.2020 | | 2.350 | 2.357 | 0,06 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 3,210 % fällig am 15.06.2021 | | 500 | 497 | 0,01 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,933 % fällig am 23.04.2021 | | 300 | 306 | 0,01 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 26.11.2023 | | 1.100 | 1.179 | 0,03 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,700 % fällig am 19.07.2019 | | 550 | 548 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2022 | € | 1.700 | 1.915 | 0,05 |
| **Toyota Industries Corp.** | | | | |
| 3,110 % fällig am 12.03.2022 | $ | 2.100 | 2.138 | 0,05 |
| **Toyota Tsusho Corp.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 13.09.2023 | | 200 | 208 | 0,01 |
| **Transocean, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 5.900 | 5.612 | 0,14 |
| **United Technologies Corp.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 16.08.2023 | | 4.300 | 4.506 | 0,11 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.08.2026 | | 2.500 | 2.852 | 0,07 |
| 6,875 % fällig am 21.11.2036 | | 500 | 603 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 10.11.2039 | | 900 | 1.085 | 0,03 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | | 2.700 | 2.723 | 0,07 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 3,305 % fällig am 13.11.2020 | | 9.600 | 9.641 | 0,24 |
| 3,875 % fällig am 13.11.2020 | | 600 | 613 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 12.11.2021 | | 1.000 | 1.032 | 0,03 |
| **West Street Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.09.2025 | | 650 | 604 | 0,02 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 10.05.2021 | | 600 | 618 | 0,02 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 30.11.2021 | | 800 | 814 | 0,02 |
| | | | 246.660 | 6,19 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **American Transmission Systems, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2022 | | 200 | 213 | 0,01 |
| **Antero Midstream Partners LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | | 7.400 | 7.419 | 0,19 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | | 6.600 | 6.635 | 0,17 |
| 3,616 % fällig am 12.06.2024 | | 1.200 | 1.216 | 0,03 |
| 3,800 % fällig am 15.03.2022 | | 2.200 | 2.283 | 0,06 |
| 4,100 % fällig am 15.02.2028 | | 306 | 324 | 0,01 |
| **Duke Energy Corp.** | | | | |
| 3,101 % fällig am 11.03.2022 | | 5.000 | 5.027 | 0,13 |
| **Enable Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.05.2028 | | 1.600 | 1.679 | 0,04 |
| **LG&E & KU Energy LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.11.2020 | | 1.100 | 1.116 | 0,03 |
| **Midwest Connector Capital Co. LLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2022 | | 600 | 615 | 0,01 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 30.06.2021 | | 3.000 | 3.008 | 0,08 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,921 % fällig am 21.08.2020 | | 6.800 | 6.798 | 0,17 |
| 3,241 % fällig am 25.02.2022 | | 8.100 | 8.149 | 0,20 |
| 3,342 % fällig am 01.09.2020 | | 800 | 809 | 0,02 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.03.2029 | | 5.000 | 5.348 | 0,13 |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | | 11.400 | 12.385 | 0,31 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,999 % fällig am 27.01.2028 | | 16.924 | 18.016 | 0,45 |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 577 | 619 | 0,02 |
| 8,750 % fällig am 23.05.2026 | | 4.200 | 5.195 | 0,13 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | |
| 3,650 % fällig am 01.06.2022 | $ | 1.200 | $ 1.230 | 0,03 |
| **Progress Energy, Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | | 600 | 611 | 0,01 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 2.277 | 2.548 | 0,06 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 1.230 | 1.418 | 0,04 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 2.450 | 2.441 | 0,06 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.03.2020 | | 1.200 | 1.233 | 0,03 |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 3.700 | 3.843 | 0,10 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.10.2023 | | 2.700 | 2.747 | 0,07 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 3,376 % fällig am 15.02.2025 | | 519 | 542 | 0,01 |
| 3,618 % fällig am 15.05.2025 | | 1.700 | 1.723 | 0,04 |
| 4,016 % fällig am 03.12.2029 | | 3.426 | 3.713 | 0,09 |
| 4,125 % fällig am 16.03.2027 | | 7.200 | 7.837 | 0,20 |
| 4,329 % fällig am 21.09.2028 | | 4.955 | 5.496 | 0,14 |
| | | | 122.236 | 3,07 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 062.832 | 26,67 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **California State General Obligation Bonds, (BABs), (AGM/CR Insured), Series 2010** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.11.2026 | | 2.345 | 3.074 | 0,08 |
| **California State General Obligation Bonds, Series 2017** | | | | |
| 3,211 % fällig am 01.04.2047 | | 2.600 | 2.609 | 0,07 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2012** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.07.2026 ^ | | 110 | 65 | 0,00 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035 | | 750 | 885 | 0,02 |
| **Texas Public Finance Authority Revenue Notes, Series 2014** | | | | |
| 8,250 % fällig am 01.07.2024 | | 610 | 613 | 0,02 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.06.2047 (e) | | 22.700 | 1.392 | 0,03 |
| 7,467 % fällig am 01.06.2047 | | 4.135 | 4.176 | 0,10 |
| | | | 12.814 | 0,32 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.03.2034 | | 124 | 124 | 0,00 |
| 2,690 % fällig am 25.11.2031 | | 26 | 25 | 0,00 |
| 2,710 % fällig am 25.02.2032 | | 39 | 39 | 0,00 |
| 2,754 % fällig am 25.03.2037 | | 52 | 52 | 0,00 |
| 2,770 % fällig am 25.11.2032 | | 15 | 14 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.09.2032 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,832 % fällig am 18.10.2030 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 3,682 % fällig am 01.11.2042 | | 55 | 54 | 0,00 |
| 4,545 % fällig am 01.12.2034 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 4,722 % fällig am 01.02.2035 | | 22 | 23 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2037 - 01.05.2049 | | 299.930 | 307.544 | 7,72 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2047 - 01.03.2049 | | 52.907 | 55.206 | 1,39 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2028 | | 21 | 22 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2026 - 01.09.2040 | | 1.233 | 1.333 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2025 - 01.05.2041 | | 606 | 676 | 0,02 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.09.2049 | | 38.500 | 38.772 | 0,97 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 170.000 | 173.760 | 4,36 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 1,638 % fällig am 25.10.2021 (a) | | 11.880 | 353 | 0,01 |
| 2,710 % fällig am 25.09.2031 | | 188 | 186 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.07.2044 | | 725 | 745 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2047 | | 674 | 704 | 0,02 |
| 4,825 % fällig am 01.09.2027 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.04.2027 - 01.01.2040 | | 1.014 | 1.119 | 0,03 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2045 | $ | 16.462 | $ 17.170 | 0,43 |
| 3,750 % fällig am 20.09.2031 | | 195 | 203 | 0,01 |
| 4,125 % fällig am 20.11.2029 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | | 8.000 | 8.332 | 0,21 |
| | | | 606.475 | 15,22 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.08.2046 | | 150 | 142 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 | | 4.220 | 4.205 | 0,11 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 | | 1.450 | 1.550 | 0,04 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2044 | | 350 | 382 | 0,01 |
| 3,125 % fällig am 15.08.2044 | | 100 | 112 | 0,00 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2021 | | 67.270 | 66.659 | 1,67 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | | 27.831 | 27.873 | 0,70 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | | 20.681 | 20.881 | 0,53 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | | 21.131 | 21.484 | 0,54 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | | 23.624 | 24.201 | 0,61 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | | 68.605 | 72.243 | 1,81 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | | 14.635 | 16.415 | 0,41 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | | 8.136 | 9.056 | 0,23 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 | | 17.540 | 19.606 | 0,49 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2027 | | 30.683 | 35.451 | 0,89 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | | 28.537 | 34.345 | 0,86 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.06.2020 | | 40 | 40 | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 30.04.2022 | | 30 | 30 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 31.05.2022 | | 8.100 | 8.138 | 0,21 |
| 1,875 % fällig am 31.07.2022 | | 46.570 | 46.786 | 1,17 |
| 2,000 % fällig am 31.12.2021 | | 7.950 | 8.005 | 0,20 |
| 2,000 % fällig am 31.07.2022 | | 182.900 | 184.443 | 4,63 |
| 2,000 % fällig am 31.05.2024 | | 47.800 | 48.367 | 1,21 |
| 2,125 % fällig am 30.09.2021 | | 46.600 | 46.999 | 1,18 |
| 2,250 % fällig am 30.04.2021 | | 47.400 | 47.803 | 1,20 |
| 2,250 % fällig am 31.01.2024 | | 20 | 20 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 30.04.2024 | | 85.200 | 87.142 | 2,19 |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 1.560 | 1.645 | 0,04 |
| | | | 834.023 | 20,93 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 2,924 % fällig am 25.01.2036 | | 2.006 | 2.001 | 0,05 |
| 4,160 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 529 | 483 | 0,01 |
| 4,318 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 496 | 475 | 0,01 |
| 4,345 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 1.857 | 1.670 | 0,04 |
| 4,430 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 95 | 90 | 0,00 |
| 4,612 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 17 | 16 | 0,00 |
| 5,116 % fällig am 25.08.2035 | | 111 | 111 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 2,614 % fällig am 25.06.2037 | | 6.460 | 6.167 | 0,16 |
| 3,424 % fällig am 25.11.2046 | | 74 | 37 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2046 | | 1.013 | 916 | 0,02 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 4,213 % fällig am 25.10.2034 | | 23 | 23 | 0,00 |
| 4,294 % fällig am 25.11.2045 ^ | | 373 | 277 | 0,01 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.06.2037 | | 1.127 | 880 | 0,02 |
| 4,236 % fällig am 25.06.2037 ^(a) | | 1.224 | 218 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 ^ | | 501 | 489 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 827 | 809 | 0,02 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 2,543 % fällig am 20.02.2047 | | 1.274 | 1.272 | 0,03 |
| 2,573 % fällig am 20.10.2046 ^ | | 421 | 396 | 0,01 |
| 2,763 % fällig am 20.07.2036 | | 9.450 | 9.329 | 0,23 |
| 2,804 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 289 | 252 | 0,01 |
| 4,312 % fällig am 20.10.2046 ^ | | 183 | 171 | 0,00 |
| 4,330 % fällig am 20.12.2034 ^ | | 19 | 17 | 0,00 |
| 4,588 % fällig am 20.06.2037 ^ | | 148 | 145 | 0,00 |
| 4,648 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 109 | 106 | 0,00 |
| 4,672 % fällig am 20.06.2036 ^ | | 32 | 31 | 0,00 |
| 4,731 % fällig am 20.04.2035 ^ | | 1.936 | 1.801 | 0,05 |
| 4,753 % fällig am 20.02.2036 | | 71 | 71 | 0,00 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 4,503 % fällig am 25.02.2035 | | 220 | 223 | 0,01 |
| 4,554 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 833 | 846 | 0,02 |
| 4,715 % fällig am 25.06.2035 | | 162 | 156 | 0,00 |
| 4,871 % fällig am 25.02.2034 | | 13 | 13 | 0,00 |
| 4,973 % fällig am 20.07.2032 | | 1 | 1 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 2,557 % fällig am 26.11.2036 | $ | 2.785 | $ 2.655 | 0,07 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 3.575 | 3.422 | 0,09 |
| 2,584 % fällig am 25.03.2037 | | 1.440 | 1.424 | 0,04 |
| 3,054 % fällig am 25.09.2047 | | 1.688 | 1.600 | 0,04 |
| 4,935 % fällig am 26.03.2037 | | 5.947 | 6.250 | 0,16 |
| 5,250 % fällig am 26.02.2036 | | 989 | 745 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 26.06.2036 | | 15.333 | 9.682 | 0,24 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2037 | | 1.433 | 1.211 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 26.06.2037 | | 440 | 427 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 26.07.2036 | | 738 | 825 | 0,02 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 4,013 % fällig am 25.09.2034 | | 203 | 205 | 0,01 |
| 4,305 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 139 | 133 | 0,00 |
| 4,314 % fällig am 25.07.2034 | | 73 | 73 | 0,00 |
| 4,401 % fällig am 25.04.2033 | | 19 | 19 | 0,00 |
| 4,436 % fällig am 25.02.2033 | | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,713 % fällig am 25.11.2034 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 4,719 % fällig am 25.01.2035 | | 53 | 54 | 0,00 |
| 4,944 % fällig am 25.11.2034 | | 45 | 43 | 0,00 |
| 4,993 % fällig am 25.01.2035 | | 101 | 103 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 2,744 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 341 | 282 | 0,01 |
| 2,844 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 895 | 1.039 | 0,03 |
| 2,884 % fällig am 25.02.2036 | | 807 | 788 | 0,02 |
| 3,104 % fällig am 25.09.2034 | | 65 | 65 | 0,00 |
| 3,999 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 35 | 32 | 0,00 |
| 4,100 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 5.903 | 3.902 | 0,10 |
| 4,110 % fällig am 25.11.2036 | | 5.249 | 4.884 | 0,12 |
| 4,131 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 531 | 462 | 0,01 |
| 4,158 % fällig am 25.04.2035 | | 97 | 92 | 0,00 |
| 4,280 % fällig am 25.01.2034 | | 81 | 81 | 0,00 |
| 4,625 % fällig am 25.05.2035 | | 642 | 656 | 0,02 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 4,162 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 730 | 718 | 0,02 |
| 4,791 % fällig am 25.02.2037 | | 51 | 52 | 0,00 |
| **ChaseFlex Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.07.2037 | | 20 | 18 | 0,00 |
| 4,215 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 1.476 | 1.468 | 0,04 |
| **Citicorp Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 | | 106 | 115 | 0,00 |
| **Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.** | | | | |
| 2,904 % fällig am 25.05.2032 | | 49 | 49 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.11.2036 | | 131 | 132 | 0,00 |
| 4,509 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 23 | 23 | 0,00 |
| 4,522 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 848 | 773 | 0,02 |
| 4,990 % fällig am 25.11.2035 | | 314 | 317 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 25.09.2035 | | 5 | 5 | 0,00 |
| 4,843 % fällig am 25.02.2034 | | 68 | 69 | 0,00 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.01.2037 | | 2.239 | 1.857 | 0,05 |
| 3,004 % fällig am 25.06.2037 | | 3.329 | 2.739 | 0,07 |
| 3,054 % fällig am 25.09.2036 | | 2.762 | 2.277 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 1.463 | 1.423 | 0,04 |
| **Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 149 | 122 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.04.2047 | | 1.273 | 1.219 | 0,03 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2047 | | 1.223 | 1.206 | 0,03 |
| 2,573 % fällig am 20.03.2047 | | 9.342 | 8.111 | 0,20 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 1.798 | 1.760 | 0,04 |
| 2,574 % fällig am 25.05.2047 | | 1.033 | 989 | 0,03 |
| 2,578 % fällig am 20.12.2046 ^ | | 13.290 | 12.030 | 0,30 |
| 2,584 % fällig am 25.05.2047 | | 1.582 | 1.537 | 0,04 |
| 2,593 % fällig am 20.03.2046 | | 100 | 93 | 0,00 |
| 2,593 % fällig am 20.05.2046 ^ | | 522 | 441 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 42 | 39 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.04.2047 | | 684 | 645 | 0,02 |
| 2,663 % fällig am 20.09.2046 | | 652 | 399 | 0,01 |
| 2,774 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 2.639 | 930 | 0,02 |
| 2,804 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 795 | 675 | 0,02 |
| 2,854 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 378 | 295 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 179 | 116 | 0,00 |
| 3,023 % fällig am 20.11.2035 | | 34 | 32 | 0,00 |
| 3,114 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 776 | 408 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 882 | 434 | 0,01 |
| 3,504 % fällig am 25.12.2035 | | 4.996 | 4.594 | 0,12 |
| 3,704 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 2.411 | 2.085 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 25.03.2035 | | 10 | 9 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | $ | 323 | $ 282 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2036 | | 43 | 39 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2035 | | 266 | 256 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 1.058 | 947 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2036 | | 749 | 549 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 608 | 521 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 | | 811 | 553 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 315 | 238 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 193 | 172 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 1.575 | 1.073 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 296 | 208 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 437 | 313 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 854 | 616 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 140 | 97 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 892 | 728 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2032 | | 373 | 385 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 660 | 449 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,862 % fällig am 25.04.2035 | | 58 | 53 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.05.2035 | | 67 | 62 | 0,00 |
| 2,984 % fällig am 25.04.2035 | | 86 | 82 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | | 515 | 478 | 0,01 |
| 3,064 % fällig am 25.02.2035 | | 5 | 5 | 0,00 |
| 3,144 % fällig am 25.02.2035 | | 1.412 | 1.352 | 0,03 |
| 3,526 % fällig am 20.02.2036 | | 965 | 824 | 0,02 |
| 3,675 % fällig am 20.05.2036 ^ | | 1.044 | 1.002 | 0,03 |
| 3,976 % fällig am 20.04.2036 ^ | | 85 | 80 | 0,00 |
| 4,178 % fällig am 25.08.2034 ^ | | 281 | 282 | 0,01 |
| 4,466 % fällig am 20.07.2034 | | 245 | 242 | 0,01 |
| 4,592 % fällig am 20.02.2036 ^ | | 87 | 78 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.12.2027 ^ | | 50 | 46 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 8 | 7 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 722 | 630 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 41 | 35 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.08.2037 | | 3.616 | 3.203 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 129 | 105 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037 | | 1.346 | 1.033 | 0,03 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.11.2034 ^ | | 41 | 41 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 0,416 % fällig am 15.05.2023 (a) | | 27.844 | 67 | 0,00 |
| 3,133 % fällig am 25.03.2032 | | 55 | 53 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 700 | 644 | 0,02 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 2,977 % fällig am 30.11.2037 | | 3.729 | 3.497 | 0,09 |
| 4,109 % fällig am 26.02.2036 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.02.2037 | | 6.339 | 4.399 | 0,11 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 72 | 59 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 444 | 366 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 1.182 | 1.071 | 0,03 |
| 2,734 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 693 | 601 | 0,02 |
| **EMF-NL Prime BV** | | | | |
| 0,490 % fällig am 17.04.2041 | € | 349 | 382 | 0,01 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 1,190 % fällig am 17.10.2040 | | 164 | 187 | 0,01 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 4,022 % fällig am 25.01.2036 ^ | $ | 637 | 494 | 0,01 |
| 4,377 % fällig am 25.09.2034 | | 199 | 200 | 0,01 |
| **First Horizon Asset Securities, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 409 | 349 | 0,01 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,518 % fällig am 25.08.2035 | | 55 | 46 | 0,00 |
| **GMAC Mortgage Corp. Loan Trust** | | | | |
| 4,210 % fällig am 19.04.2036 ^ | | 82 | 75 | 0,00 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 2,532 % fällig am 18.06.2039 | | 59 | 57 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,944 % fällig am 25.11.2045 | | 358 | 316 | 0,01 |
| **GSMSC Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 26.10.2035 | | 1.430 | 1.260 | 0,03 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,146 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 138 | 115 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 23 | 25 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 41 | 37 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 1.074 | 812 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 97 | 84 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 270 | 251 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 117 | 92 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.05.2038 | $ | 1.081 | $ 947 | 0,02 |
| 2,830 % fällig am 19.05.2035 | | 74 | 72 | 0,00 |
| 2,890 % fällig am 19.01.2036 | | 1.042 | 833 | 0,02 |
| 2,945 % fällig am 19.06.2045 ^ | | 1.346 | 883 | 0,02 |
| 2,950 % fällig am 19.02.2036 | | 365 | 309 | 0,01 |
| 3,210 % fällig am 19.11.2034 ^ | | 187 | 176 | 0,00 |
| 4,264 % fällig am 19.10.2033 | | 61 | 62 | 0,00 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 4,197 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 4.422 | 4.129 | 0,10 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 3,044 % fällig am 25.09.2034 | | 13 | 13 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | | 903 | 897 | 0,02 |
| 3,064 % fällig am 25.03.2035 | | 781 | 779 | 0,02 |
| 3,184 % fällig am 25.10.2034 | | 1.015 | 1.010 | 0,03 |
| 3,324 % fällig am 25.11.2034 | | 52 | 51 | 0,00 |
| **IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 3,909 % fällig am 25.01.2032 | | 25 | 24 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,614 % fällig am 25.07.2036 | | 1.433 | 1.340 | 0,03 |
| 2,704 % fällig am 25.07.2035 | | 388 | 374 | 0,01 |
| 3,123 % fällig am 25.06.2037 | | 1.109 | 805 | 0,02 |
| 3,204 % fällig am 25.11.2034 | | 177 | 171 | 0,00 |
| 3,224 % fällig am 25.11.2034 ^ | | 128 | 113 | 0,00 |
| 3,569 % fällig am 25.07.2037 | | 2.708 | 2.282 | 0,06 |
| 3,835 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 99 | 84 | 0,00 |
| 4,119 % fällig am 25.06.2036 | | 426 | 402 | 0,01 |
| 4,403 % fällig am 25.10.2034 | | 340 | 354 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 2.941 | 1.756 | 0,04 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 4,328 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 439 | 401 | 0,01 |
| 5,658 % fällig am 26.05.2037 | | 1.931 | 1.657 | 0,04 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 3,722 % fällig am 27.07.2037 | | 270 | 276 | 0,01 |
| 4,243 % fällig am 25.05.2034 | | 9 | 10 | 0,00 |
| 4,248 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 313 | 291 | 0,01 |
| 4,313 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 51 | 48 | 0,00 |
| 4,392 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 21 | 19 | 0,00 |
| 4,488 % fällig am 25.12.2034 | | 49 | 50 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 78 | 62 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 394 | 315 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 194 | 148 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 336 | 245 | 0,01 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | |
| 4,045 % fällig am 27.09.2036 | | 85 | 87 | 0,00 |
| **Lanark Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,478 % fällig am 22.12.2069 | £ | 3.000 | 3.821 | 0,10 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | | |
| 5,734 % fällig am 25.04.2036 ^ | $ | 1.432 | 1.276 | 0,03 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 0 | 115 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.08.2047 ^ | | 941 | 846 | 0,02 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 55 | 53 | 0,00 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 3,475 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 396 | 378 | 0,01 |
| 4,546 % fällig am 25.05.2034 | | 125 | 129 | 0,00 |
| **MASTR Seasoned Securitization Trust** | | | | |
| 4,027 % fällig am 25.10.2032 | | 203 | 209 | 0,01 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,094 % fällig am 15.11.2031 | | 50 | 50 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,834 % fällig am 15.12.2030 | | 663 | 650 | 0,02 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.11.2035 | | 128 | 123 | 0,00 |
| 4,347 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 793 | 576 | 0,02 |
| 4,453 % fällig am 25.02.2035 | | 25 | 26 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,703 % fällig am 25.11.2037 | | 2.732 | 2.340 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 25.09.2022 ^ | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | | |
| 3,474 % fällig am 25.02.2035 | | 891 | 897 | 0,02 |
| 4,099 % fällig am 25.10.2035 | | 218 | 220 | 0,01 |
| 4,558 % fällig am 25.06.2036 | | 2.911 | 2.578 | 0,07 |
| **Nomura Resecuritization Trust** | | | | |
| 4,117 % fällig am 26.12.2046 | | 1.044 | 1.058 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 5,675 % fällig am 25.12.2035 | $ | 5 | $ 5 | 0,00 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.07.2034 | | 636 | 599 | 0,02 |
| **RBSGC Structured Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 1.581 | 1.510 | 0,04 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,680 % fällig am 26.02.2037 | | 1.535 | 1.529 | 0,04 |
| 2,910 % fällig am 27.06.2036 | | 6.646 | 4.135 | 0,10 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.02.2047 | | 3.698 | 2.146 | 0,05 |
| 2,594 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 1.363 | 1.296 | 0,03 |
| 2,594 % fällig am 25.12.2036 | | 718 | 703 | 0,02 |
| 2,594 % fällig am 25.05.2047 | | 866 | 844 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.08.2037 | | 223 | 213 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.08.2035 | | 62 | 56 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 228 | 173 | 0,00 |
| 2,964 % fällig am 25.12.2045 | | 134 | 117 | 0,00 |
| 4,004 % fällig am 25.08.2035 | | 116 | 112 | 0,00 |
| 4,830 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 294 | 270 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 607 | 568 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 218 | 214 | 0,01 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 3,104 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 3.443 | 2.953 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 24 | 20 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 117 | 95 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 169 | 119 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 429 | 280 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | |
| 4,903 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 78 | 75 | 0,00 |
| 5,217 % fällig am 27.07.2037 ^ | | 468 | 420 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 700 | 686 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032 | | 35 | 36 | 0,00 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 3,280 % fällig am 16.12.2059 | | 1.270 | 1.271 | 0,03 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,940 % fällig am 25.03.2037 | | 793 | 825 | 0,02 |
| 4,113 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 224 | 189 | 0,01 |
| 4,284 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 434 | 414 | 0,01 |
| 4,469 % fällig am 25.09.2034 | | 751 | 772 | 0,02 |
| 4,475 % fällig am 25.12.2034 | | 36 | 36 | 0,00 |
| 4,566 % fällig am 25.02.2034 | | 116 | 118 | 0,00 |
| 4,576 % fällig am 25.09.2035 | | 316 | 308 | 0,01 |
| 4,714 % fällig am 25.04.2034 | | 3 | 3 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.08.2036 | | 1.219 | 1.139 | 0,03 |
| 2,594 % fällig am 25.06.2036 | | 255 | 257 | 0,01 |
| 2,604 % fällig am 25.10.2036 | | 3.531 | 3.277 | 0,08 |
| 2,614 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 155 | 146 | 0,00 |
| 2,640 % fällig am 19.07.2035 | | 342 | 339 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 4,472 % fällig am 25.12.2033 | | 141 | 144 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 4,413 % fällig am 25.06.2033 | | 6 | 6 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,084 % fällig am 25.04.2043 | | 258 | 260 | 0,01 |
| 3,452 % fällig am 25.06.2037 | | 4.009 | 3.801 | 0,10 |
| 3,654 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 1.025 | 975 | 0,03 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 13.600 | 17.375 | 0,44 |
| **UBS-Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 2,373 % fällig am 10.01.2045 (a) | $ | 5.099 | 196 | 0,01 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust LLC** | | | | |
| 4,646 % fällig am 20.08.2035 ^ | | 192 | 189 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,458 % fällig am 25.12.2046 | | 321 | 324 | 0,01 |
| 2,595 % fällig am 25.07.2046 | | 374 | 360 | 0,01 |
| 2,595 % fällig am 25.08.2046 | | 2.995 | 2.865 | 0,07 |
| 2,595 % fällig am 25.11.2046 | | 3.520 | 3.538 | 0,09 |
| 2,664 % fällig am 25.11.2045 | | 1.684 | 1.704 | 0,04 |
| 2,984 % fällig am 25.07.2045 | | 224 | 223 | 0,01 |
| 3,234 % fällig am 25.01.2047 | | 381 | 392 | 0,01 |
| 3,244 % fällig am 25.01.2047 ^ | | 127 | 123 | 0,00 |
| 3,254 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 11 | 4 | 0,00 |
| 3,264 % fällig am 25.04.2047 | | 2.353 | 2.365 | 0,06 |
| 3,292 % fällig am 25.12.2046 | | 274 | 276 | 0,01 |
| 3,484 % fällig am 25.06.2046 | | 288 | 286 | 0,01 |
| 3,492 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 56 | 47 | 0,00 |
| 3,504 % fällig am 25.08.2046 | $ | 298 | $ 279 | 0,01 |
| 3,696 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 143 | 135 | 0,00 |
| 3,897 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 302 | 294 | 0,01 |
| 3,904 % fällig am 25.06.2042 | | 32 | 32 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.08.2042 | | 76 | 75 | 0,00 |
| 4,229 % fällig am 25.03.2036 | | 27 | 26 | 0,00 |
| 4,380 % fällig am 25.09.2033 | | 94 | 97 | 0,00 |
| 4,814 % fällig am 25.03.2034 | | 648 | 672 | 0,02 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 1,775 % fällig am 21.09.2049 | £ | 2.007 | 2.562 | 0,06 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.07.2036 ^ | $ | 2.137 | 1.205 | 0,03 |
| 3,104 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 678 | 512 | 0,01 |
| 3,224 % fällig am 25.12.2046 | | 4.591 | 4.083 | 0,10 |
| 3,941 % fällig am 25.02.2033 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 825 | 808 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 612 | 598 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 231 | 189 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 468 | 487 | 0,01 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 559 | 401 | 0,01 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 4,703 % fällig am 25.10.2033 | | 53 | 54 | 0,00 |
| 4,859 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 26 | 26 | 0,00 |
| 4,992 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 150 | 152 | 0,00 |
| 5,146 % fällig am 25.03.2035 | | 41 | 42 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 103 | 101 | 0,00 |
| | | | 266.843 | 6,69 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,534 % fällig am 25.02.2037 | | 106 | 106 | 0,00 |
| 2,945 % fällig am 25.09.2035 | | 6.171 | 5.475 | 0,14 |
| **Accunia European CLO BV** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 4.200 | 4.792 | 0,12 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.08.2036 ^ | $ | 1.623 | 526 | 0,01 |
| 2,954 % fällig am 25.12.2045 ^ | | 1.523 | 1.108 | 0,03 |
| **Aircraft Certificate Owner Trust** | | | | |
| 7,001 % fällig am 20.09.2022 | | 94 | 97 | 0,00 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.11.2035 | | 10.400 | 10.330 | 0,26 |
| 3,424 % fällig am 25.09.2034 | | 3.700 | 3.716 | 0,09 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | |
| 3,104 % fällig am 25.10.2031 | | 47 | 46 | 0,00 |
| **AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,344 % fällig am 25.06.2029 | | 7 | 7 | 0,00 |
| **Argent Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.05.2035 | | 1.731 | 1.672 | 0,04 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.05.2036 | | 633 | 236 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | | 1.889 | 674 | 0,02 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 6.460 | 5.634 | 0,14 |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | | 2.232 | 915 | 0,02 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.10.2035 | | 782 | 786 | 0,02 |
| 4,279 % fällig am 25.04.2034 | | 64 | 65 | 0,00 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.01.2037 | | 1.377 | 898 | 0,02 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | | 597 | 392 | 0,01 |
| 3,104 % fällig am 25.06.2034 | | 1.127 | 1.124 | 0,03 |
| 3,454 % fällig am 25.03.2034 ^ | | 723 | 681 | 0,02 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,499 % fällig am 25.02.2035 | | 2.585 | 2.604 | 0,07 |
| 3,639 % fällig am 15.08.2033 | | 1.955 | 1.970 | 0,05 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 26.04.2029 | € | 700 | 798 | 0,02 |
| **Avery Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,721 % fällig am 18.01.2025 | $ | 1.424 | 1.426 | 0,04 |
| **Babson Euro CLO BV** | | | | |
| 0,509 % fällig am 25.10.2029 | € | 4.050 | 4.594 | 0,12 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.11.2036 | $ | 2.750 | 2.702 | 0,07 |
| 2,574 % fällig am 25.10.2036 | | 568 | 569 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.06.2047 | $ | 288 | $ 289 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.05.2037 | | 859 | 859 | 0,02 |
| 2,634 % fällig am 25.02.2037 | | 3.092 | 2.821 | 0,07 |
| 2,690 % fällig am 25.12.2036 | | 910 | 910 | 0,02 |
| 2,904 % fällig am 25.12.2035 | | 2.182 | 2.187 | 0,06 |
| 3,034 % fällig am 25.02.2036 | | 2.705 | 2.703 | 0,07 |
| 3,079 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 4.366 | 4.377 | 0,11 |
| 3,104 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 1.345 | 1.255 | 0,03 |
| 4,279 % fällig am 25.08.2034 | | 1.589 | 1.594 | 0,04 |
| 4,366 % fällig am 25.07.2036 | | 289 | 291 | 0,01 |
| 4,858 % fällig am 25.06.2043 | | 89 | 91 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2036 | | 93 | 94 | 0,00 |
| **Belle Haven ABS CDO Ltd.** | | | | |
| 2,936 % fällig am 03.11.2044 | | 5.701 | 2.495 | 0,06 |
| 2,976 % fällig am 03.11.2044 | | 8.432 | 3.732 | 0,09 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 15.04.2027 | € | 360 | 409 | 0,01 |
| **Business Jet Securities LLC** | | | | |
| 4,447 % fällig am 15.06.2033 | $ | 2.452 | 2.490 | 0,06 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,870 % fällig am 18.01.2030 | € | 5.000 | 5.694 | 0,14 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,780 % fällig am 16.04.2029 | | 1.700 | 1.949 | 0,05 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.10.2036 | $ | 7.517 | 7.029 | 0,18 |
| 2,644 % fällig am 25.06.2036 | | 1.150 | 1.104 | 0,03 |
| 2,654 % fällig am 25.10.2036 | | 1.358 | 1.078 | 0,03 |
| 2,864 % fällig am 25.06.2035 | | 173 | 173 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.05.2034 | | 692 | 710 | 0,02 |
| **Castle Park CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.01.2028 | € | 2.300 | 2.626 | 0,07 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,024 % fällig am 25.09.2034 | $ | 482 | 484 | 0,01 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,780 % fällig am 25.10.2037 | | 4.412 | 4.474 | 0,11 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.12.2036 | | 345 | 268 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.07.2045 | | 2.029 | 1.615 | 0,04 |
| 2,604 % fällig am 25.05.2037 | | 5.844 | 4.347 | 0,11 |
| 2,654 % fällig am 25.08.2036 | | 4.856 | 4.801 | 0,12 |
| 2,664 % fällig am 25.09.2036 | | 936 | 812 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,349 % fällig am 25.10.2034 | | 650 | 652 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 271 | 273 | 0,01 |
| 3,164 % fällig am 25.12.2033 | | 8 | 8 | 0,00 |
| **Columbia Cent CLO Ltd.** | | | | |
| 3,730 % fällig am 25.10.2028 | | 6.600 | 6.595 | 0,17 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.12.2046 | | 355 | 356 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 160 | 159 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2034 | | 715 | 713 | 0,02 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 763 | 760 | 0,02 |
| 2,604 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 7.353 | 6.565 | 0,16 |
| 2,614 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 3.059 | 2.610 | 0,07 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 4.302 | 3.835 | 0,10 |
| 2,694 % fällig am 25.06.2036 | | 786 | 786 | 0,02 |
| 2,744 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 140 | 92 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.02.2036 | | 74 | 74 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.08.2035 | | 2.194 | 2.207 | 0,06 |
| 4,129 % fällig am 25.05.2035 | | 1.400 | 1.411 | 0,04 |
| 4,758 % fällig am 25.10.2032 ^ | | 4.824 | 4.420 | 0,11 |
| 4,763 % fällig am 25.07.2036 | | 3.100 | 3.215 | 0,08 |
| 4,804 % fällig am 25.01.2034 ^ | | 831 | 697 | 0,02 |
| 5,430 % fällig am 25.02.2033 ^ | | 96 | 91 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 4,354 % fällig am 25.08.2035 | | 1.485 | 1.495 | 0,04 |
| 6,095 % fällig am 25.08.2035 | | 548 | 567 | 0,01 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 3,024 % fällig am 25.01.2032 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Asset-Backed Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.09.2037 | | 874 | 859 | 0,02 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 3,426 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 788 | 725 | 0,02 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,816 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 11.397 | 6.421 | 0,16 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 2,474 % fällig am 25.01.2037 ^ | $ | 172 | $ 73 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.07.2036 | | 2.300 | 2.238 | 0,06 |
| 3,570 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 177 | 79 | 0,00 |
| **CSAB Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 5,720 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 4.490 | 2.574 | 0,06 |
| **Delta Funding Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,214 % fällig am 15.09.2029 | | 7 | 7 | 0,00 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | | |
| 0,880 % fällig am 15.01.2030 | € | 5.000 | 5.700 | 0,14 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.10.2027 | $ | 2.700 | 2.697 | 0,07 |
| **Educational Funding Co. LLC** | | | | |
| 2,830 % fällig am 25.10.2029 | | 85 | 85 | 0,00 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | € | 2.300 | 2.619 | 0,07 |
| **EMC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,144 % fällig am 25.05.2040 | $ | 164 | 163 | 0,00 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,590 % fällig am 25.11.2036 | | 1.420 | 928 | 0,02 |
| 2,744 % fällig am 25.04.2047 | | 6.075 | 4.650 | 0,12 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.11.2035 | | 2.268 | 2.207 | 0,06 |
| 3,004 % fällig am 25.07.2035 | | 2.400 | 2.414 | 0,06 |
| 3,199 % fällig am 25.09.2035 | | 498 | 500 | 0,01 |
| 3,214 % fällig am 25.04.2035 | | 437 | 440 | 0,01 |
| 3,289 % fällig am 25.03.2035 | | 751 | 757 | 0,02 |
| **First NLC Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.08.2037 | | 8.822 | 5.711 | 0,14 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 2,530 % fällig am 25.08.2036 | | 744 | 323 | 0,01 |
| 2,534 % fällig am 25.11.2036 | | 2.195 | 1.008 | 0,03 |
| 2,539 % fällig am 25.10.2036 | | 2.728 | 2.570 | 0,06 |
| 2,574 % fällig am 25.02.2037 | | 2.047 | 1.054 | 0,03 |
| 2,654 % fällig am 25.05.2036 | | 1.520 | 1.068 | 0,03 |
| 2,814 % fällig am 25.11.2035 | | 9.988 | 9.141 | 0,23 |
| 3,139 % fällig am 25.07.2035 | | 2.200 | 2.210 | 0,06 |
| 3,154 % fällig am 25.02.2034 | | 361 | 356 | 0,01 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | € | 3.500 | 3.989 | 0,10 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.08.2037 | $ | 497 | 486 | 0,01 |
| 5,985 % fällig am 25.06.2036 | | 7.612 | 3.519 | 0,09 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.11.2036 | | 3.604 | 2.200 | 0,06 |
| 2,664 % fällig am 25.06.2036 | | 4.162 | 4.041 | 0,10 |
| 2,674 % fällig am 25.04.2036 | | 807 | 613 | 0,02 |
| **Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.** | | | | |
| 3,512 % fällig am 20.04.2027 | | 5.996 | 5.980 | 0,15 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,589 % fällig am 25.07.2037 | | 87 | 87 | 0,00 |
| 3,499 % fällig am 25.05.2035 | | 500 | 502 | 0,01 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.07.2037 | | 972 | 668 | 0,02 |
| 2,644 % fällig am 25.04.2037 | | 1.169 | 895 | 0,02 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.12.2036 | | 1.871 | 757 | 0,02 |
| 2,594 % fällig am 25.01.2037 | | 1.179 | 941 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.12.2036 | | 2.840 | 1.164 | 0,03 |
| 2,924 % fällig am 25.01.2036 | | 9.268 | 8.589 | 0,22 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.01.2037 | | 328 | 166 | 0,00 |
| **Jamestown CLO Ltd.** | | | | |
| 3,287 % fällig am 15.07.2026 | | 925 | 923 | 0,02 |
| 3,467 % fällig am 15.01.2028 | | 4.200 | 4.187 | 0,11 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 25.05.2035 | | 424 | 424 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 795 | 463 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.05.2036 | | 5.768 | 5.732 | 0,14 |
| 2,674 % fällig am 25.07.2036 | | 3.100 | 3.013 | 0,08 |
| 4,686 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 1.248 | 910 | 0,02 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.05.2036 | | 4.024 | 4.105 | 0,10 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.11.2036 | | 11.077 | 4.990 | 0,13 |
| 2,624 % fällig am 25.02.2036 | | 4.205 | 4.125 | 0,10 |
| 2,704 % fällig am 25.02.2036 | | 352 | 308 | 0,01 |
| 3,084 % fällig am 25.01.2046 | $ | 4.000 | $ 4.004 | 0,10 |
| 3,164 % fällig am 25.08.2045 | | 1.016 | 1.025 | 0,03 |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 3,530 % fällig am 25.04.2038 | | 1.186 | 1.193 | 0,03 |
| **MASTR Specialized Loan Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.05.2037 | | 135 | 114 | 0,00 |
| 2,774 % fällig am 25.01.2037 | | 1.471 | 832 | 0,02 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.07.2037 | | 1.462 | 820 | 0,02 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2037 | | 15.521 | 10.221 | 0,26 |
| 2,664 % fällig am 25.03.2037 | | 4.198 | 3.764 | 0,09 |
| 2,664 % fällig am 25.04.2037 | | 1.885 | 1.159 | 0,03 |
| 2,664 % fällig am 25.05.2037 | | 1.417 | 1.083 | 0,03 |
| 2,724 % fällig am 25.03.2037 | | 1.462 | 1.320 | 0,03 |
| 2,794 % fällig am 25.12.2036 | | 1.382 | 1.384 | 0,03 |
| **Monroe Capital BSL CLO Ltd.** | | | | |
| 3,643 % fällig am 22.05.2027 | | 12.500 | 12.506 | 0,31 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.12.2036 | | 1.463 | 899 | 0,02 |
| 2,534 % fällig am 25.10.2036 | | 1.024 | 990 | 0,02 |
| 2,544 % fällig am 25.10.2036 | | 35 | 22 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.11.2036 | | 888 | 555 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.05.2037 | | 4.699 | 4.221 | 0,11 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | | 23 | 19 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | | 79 | 39 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.10.2036 | | 8.402 | 5.309 | 0,13 |
| 2,554 % fällig am 25.11.2036 | | 1.470 | 1.059 | 0,03 |
| 2,554 % fällig am 25.12.2036 | | 315 | 195 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.03.2037 | | 1.318 | 722 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2036 | | 1.347 | 842 | 0,02 |
| 2,634 % fällig am 25.10.2036 | | 5.242 | 3.346 | 0,08 |
| 2,654 % fällig am 25.03.2037 | | 694 | 384 | 0,01 |
| 3,184 % fällig am 25.01.2035 | | 3.200 | 3.107 | 0,08 |
| 3,349 % fällig am 25.06.2034 | | 883 | 889 | 0,02 |
| 3,379 % fällig am 25.07.2035 | | 2.182 | 2.191 | 0,06 |
| 3,454 % fällig am 25.09.2033 | | 142 | 143 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.03.2036 | | 1.478 | 1.222 | 0,03 |
| **Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 2.009 | 1.053 | 0,03 |
| **Mountain Hawk CLO Ltd.** | | | | |
| 3,412 % fällig am 20.07.2024 | | 1.305 | 1.305 | 0,03 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.03.2035 | | 536 | 530 | 0,01 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,734 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 2.334 | 789 | 0,02 |
| 3,289 % fällig am 25.09.2035 | | 950 | 958 | 0,02 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.09.2037 | | 2.616 | 2.582 | 0,06 |
| 2,574 % fällig am 25.11.2036 | | 2.556 | 1.136 | 0,03 |
| 2,614 % fällig am 25.01.2037 | | 1.604 | 757 | 0,02 |
| 4,305 % fällig am 25.03.2035 | | 1.350 | 1.358 | 0,03 |
| **OFSI Fund Ltd.** | | | | |
| 3,501 % fällig am 18.10.2026 | | 4.299 | 4.296 | 0,11 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.04.2037 | | 6.666 | 5.316 | 0,13 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | | 5.364 | 3.718 | 0,09 |
| 3,139 % fällig am 25.08.2035 | | 1.204 | 1.210 | 0,03 |
| **Orwell Park CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,780 % fällig am 18.07.2029 | € | 1.000 | 1.140 | 0,03 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.05.2037 | $ | 912 | 766 | 0,02 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 3,633 % fällig am 30.04.2027 | | 900 | 900 | 0,02 |
| 3,663 % fällig am 30.07.2027 | | 5.950 | 5.947 | 0,15 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.08.2035 | | 1.514 | 1.523 | 0,04 |
| 3,154 % fällig am 25.07.2035 | | 15 | 15 | 0,00 |
| 3,349 % fällig am 25.06.2035 | | 3.800 | 3.819 | 0,10 |
| 3,724 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 1.600 | 1.604 | 0,04 |
| **People's Choice Home Loan Securities Trust** | | | | |
| 3,349 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 4.700 | 4.277 | 0,11 |
| 3,754 % fällig am 25.01.2035 | | 1.189 | 1.170 | 0,03 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,614 % fällig am 25.01.2037 | | 2.267 | 2.202 | 0,06 |
| **RAAC Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.06.2044 | | 265 | 242 | 0,01 |
| 2,784 % fällig am 25.10.2046 | | 2.459 | 2.441 | 0,06 |
| 3,604 % fällig am 25.10.2045 | $ | 2.450 | $ 2.483 | 0,06 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,104 % fällig am 25.08.2032 | | 9 | 9 | 0,00 |
| 3,345 % fällig am 25.09.2037 | | 830 | 655 | 0,02 |
| 3,404 % fällig am 25.12.2033 | | 72 | 71 | 0,00 |
| 5,612 % fällig am 25.04.2037 | | 2.973 | 1.349 | 0,03 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.02.2037 | | 1.154 | 1.152 | 0,03 |
| 2,774 % fällig am 25.05.2037 | | 5.768 | 5.228 | 0,13 |
| 2,964 % fällig am 25.06.2032 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 3,334 % fällig am 25.05.2035 | | 1.850 | 1.861 | 0,05 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 2.668 | 2.550 | 0,06 |
| 2,574 % fällig am 25.11.2036 | | 4.384 | 3.841 | 0,10 |
| 2,664 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 1.045 | 830 | 0,02 |
| 2,674 % fällig am 25.07.2036 | | 1.341 | 1.105 | 0,03 |
| 2,844 % fällig am 25.01.2036 | | 995 | 999 | 0,03 |
| 3,229 % fällig am 25.07.2034 | | 714 | 711 | 0,02 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.10.2046 | | 887 | 873 | 0,02 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 3,064 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 3.513 | 2.398 | 0,06 |
| 3,169 % fällig am 25.02.2034 | | 566 | 562 | 0,01 |
| 3,364 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 571 | 456 | 0,01 |
| **SG Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,614 % fällig am 25.10.2036 | | 1.700 | 1.397 | 0,04 |
| **Sierra Madre Funding Ltd.** | | | | |
| 2,799 % fällig am 07.09.2039 | | 4.175 | 3.768 | 0,09 |
| 2,819 % fällig am 07.09.2039 | | 23.955 | 21.619 | 0,54 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2023 | € | 161 | 183 | 0,00 |
| 4,080 % fällig am 25.04.2023 | $ | 491 | 496 | 0,01 |
| **SoFi Consumer Loan Program LLC** | | | | |
| 2,770 % fällig am 25.05.2026 | | 2.098 | 2.102 | 0,05 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.11.2036 | | 304 | 130 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.08.2037 | | 2.438 | 2.249 | 0,06 |
| 2,614 % fällig am 25.06.2037 | | 3.788 | 2.712 | 0,07 |
| 2,684 % fällig am 25.10.2036 | | 898 | 896 | 0,02 |
| 2,684 % fällig am 25.06.2037 | | 5.480 | 3.951 | 0,10 |
| 3,304 % fällig am 25.10.2037 | | 5.408 | 4.529 | 0,11 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2037 | | 612 | 290 | 0,01 |
| 3,004 % fällig am 25.12.2036 | | 2.766 | 2.729 | 0,07 |
| 3,229 % fällig am 25.05.2035 | | 424 | 426 | 0,01 |
| 4,268 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.869 | 1.044 | 0,03 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 3,094 % fällig am 25.06.2035 | | 324 | 325 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 25.05.2035 | | 5.237 | 5.269 | 0,13 |
| 3,124 % fällig am 25.10.2035 | | 496 | 497 | 0,01 |
| 3,139 % fällig am 25.08.2035 | | 480 | 482 | 0,01 |
| 3,379 % fällig am 25.01.2035 | | 5.219 | 5.114 | 0,13 |
| 3,529 % fällig am 25.01.2035 | | 397 | 344 | 0,01 |
| 3,979 % fällig am 25.01.2035 | | 456 | 242 | 0,01 |
| 4,129 % fällig am 25.01.2035 ^ | | 269 | 27 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.01.2037 | | 1.021 | 549 | 0,01 |
| 2,724 % fällig am 25.05.2037 | | 14 | 14 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.11.2037 | | 3.640 | 3.514 | 0,09 |
| 3,079 % fällig am 25.11.2035 | | 2.529 | 2.541 | 0,06 |
| 3,409 % fällig am 25.11.2035 | | 6.400 | 6.433 | 0,16 |
| 3,940 % fällig am 25.04.2035 | | 182 | 180 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,864 % fällig am 25.09.2035 | | 8.500 | 8.246 | 0,21 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,880 % fällig am 07.12.2029 (b) | € | 11.000 | 12.527 | 0,31 |
| 1,060 % fällig am 07.12.2029 | | 1.600 | 1.824 | 0,05 |
| **Tralee CLO Ltd.** | | | | |
| 3,622 % fällig am 20.10.2027 | $ | 7.400 | 7.401 | 0,19 |
| **Triaxx Prime CDO Ltd.** | | | | |
| 2,741 % fällig am 02.10.2039 | | 3.305 | 1.801 | 0,05 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 3,447 % fällig am 15.01.2028 | | 3.600 | 3.590 | 0,09 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | | 4.387 | 4.408 | 0,11 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 2,629 % fällig am 25.05.2037 | | 5.474 | 5.278 | 0,13 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.05.2036 | | 1.236 | 1.060 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,644 % fällig am 25.05.2036 | $ | 1.010 | $ 877 | 0,02 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.04.2037 | | 2.867 | 1.805 | 0,05 |
| 3,454 % fällig am 25.10.2034 | | 386 | 381 | 0,01 |
| 4,129 % fällig am 25.11.2035 | | 7.389 | 7.496 | 0,19 |
| **Zais CLO Ltd.** | | | | |
| 3,747 % fällig am 15.04.2028 | | 5.000 | 5.011 | 0,13 |
| | | | 558.171 | 14,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 5,875 % fällig am 11.01.2028 (k) | | 7.700 | 5.876 | 0,15 |
| 6,875 % fällig am 11.01.2048 | | 3.500 | 2.603 | 0,07 |
| 40,244 % fällig am 04.10.2022 | ARS | 3.300 | 116 | 0,00 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | | 19.290 | 392 | 0,01 |
| 53,892 % fällig am 01.03.2020 (a) | | 800 | 18 | 0,00 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 393.874 | 9.071 | 0,23 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | € | 200 | 234 | 0,01 |
| **Brazil Government International Bond** | | | | |
| 5,625 % fällig am 21.02.2047 | $ | 1.150 | 1.229 | 0,03 |
| **Kuwait International Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.03.2022 | | 1.550 | 1.573 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2027 | | 8.600 | 9.169 | 0,23 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 16.300 | 5.411 | 0,14 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 53.300 | 17.836 | 0,45 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 41.300 | 14.109 | 0,35 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 11.900 | 4.503 | 0,11 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 4.900 | 5.145 | 0,13 |
| 4,500 % fällig am 23.04.2028 | | 5.100 | 5.714 | 0,14 |
| **Republic of Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.01.2023 | € | 154 | 190 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 30.01.2028 | | 360 | 456 | 0,01 |
| 3,900 % fällig am 30.01.2033 | | 2.035 | 2.602 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 30.01.2037 | | 1.120 | 1.444 | 0,04 |
| 4,200 % fällig am 30.01.2042 | | 1.732 | 2.260 | 0,06 |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 26.10.2021 | $ | 550 | 550 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 26.10.2026 | | 4.000 | 4.087 | 0,10 |
| 3,625 % fällig am 04.03.2028 | | 4.000 | 4.116 | 0,10 |
| 4,500 % fällig am 17.04.2030 | | 11.000 | 12.020 | 0,30 |
| 4,500 % fällig am 26.10.2046 | | 2.700 | 2.751 | 0,07 |
| 4,625 % fällig am 04.10.2047 | | 4.400 | 4.565 | 0,11 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 7,250 % fällig am 23.12.2023 | | 5.500 | 5.694 | 0,14 |
| | | | 123.734 | 3,10 |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (i)** | | 770.713 | $ 8.170 | 0,21 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (i)** | | 8.779.248 | 88.583 | 2,22 |
| | | | 96.753 | 2,43 |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **FINANZWESEN** | | | | |
| **National Bank of Greece S.A. (d)** | | 307.710 | 844 | 0,02 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % | | 12.734 | 2.453 | 0,06 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (i)** | | 1.328.250 | 134.804 | 3,38 |
| | | PARI (000S) | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Bank of Montreal** | | | | |
| 1,802 % fällig am 12.07.2019 | CAD | 6.100 | 4.665 | 0,12 |
| 1,804 % fällig am 08.07.2019 | | 30.000 | 22.948 | 0,58 |
| 1,806 % fällig am 31.07.2019 | | 26.700 | 20.400 | 0,51 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | |
| 1,804 % fällig am 08.07.2019 | | 16.200 | 12.392 | 0,31 |
| **Boston Scientific Corp.** | | | | |
| 2,910 % fällig am 10.07.2019 | $ | 5.600 | 5.595 | 0,14 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 2,830 % fällig am 18.07.2019 | | 4.100 | 4.094 | 0,10 |
| 2,870 % fällig am 16.07.2019 | | 4.100 | 4.094 | 0,10 |
| 2,910 % fällig am 09.07.2019 | | 7.800 | 7.794 | 0,20 |
| **C.I.B.C.** | | | | |
| 1,802 % fällig am 12.07.2019 | CAD | 6.100 | 4.665 | 0,12 |
| 1,819 % fällig am 17.07.2019 | | 10.000 | 7.646 | 0,19 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 15.08.2019 | $ | 4.300 | 4.285 | 0,11 |
| **Encana Corp.** | | | | |
| 3,120 % fällig am 02.07.2019 | $ | 3.500 | $ 3.499 | 0,09 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 3,030 % fällig am 02.07.2019 | | 7.800 | 7.798 | 0,20 |
| **HSBC Bank Canada** | | | | |
| 1,828 % fällig am 26.07.2019 | CAD | 5.900 | 4.509 | 0,11 |
| 1,854 % fällig am 11.07.2019 | | 14.100 | 10.784 | 0,27 |
| 1,855 % fällig am 04.07.2019 | | 14.800 | 11.323 | 0,28 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 1,800 % fällig am 04.07.2019 | | 14.800 | 11.323 | 0,28 |
| 1,801 % fällig am 11.07.2019 | | 5.500 | 4.206 | 0,11 |
| **Royal Caribbean Cruise** | | | | |
| 2,850 % fällig am 30.07.2019 | $ | 3.700 | 3.692 | 0,09 |
| 2,900 % fällig am 11.07.2019 | | 3.800 | 3.796 | 0,09 |
| | | | 159.508 | 4,00 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (l)** | | | | |
| | | | 17.690 | 0,45 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 10,244 % fällig am 19.07.2019 (e)(f) | ARS | 4.508 | 115 | 0,00 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 177.313 | 4,45 |
| | | ANZAHL | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)** | | 14.809.713 | 148.319 | 3,72 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 059.403** | **101,85** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar September Futures | Short | 09/2019 | 3.559 | $ (627) | (0,02) |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2019 | 1.691 | (9.676) | (0,24) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 250 | (484) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1.984 | 3.105 | 0,08 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1.275 | 3.146 | 0,08 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 25 | (146) | (0,01) |
| | | | | $ (4.682) | (0,12) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (4.682)** | **(0,12)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 8.300 | $ 60 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.09.2020 | 16.300 | (144) | (0,01) |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.03.2023 | 1.600 | 14 | 0,00 |
| Daimler AG | 1,000 | 20.12.2020 | € 1.100 | (2) | 0,00 |
| DISH DBS Corp. | 5,000 | 20.09.2021 | $ 2.500 | (119) | (0,01) |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2021 | 14.300 | (2) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.06.2022 | 5.600 | 25 | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 7.200 | 16 | 0,00 |
| | | | | $ (152) | (0,02) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Main 26 5-Year Index | (1,000) % | 20.12.2021 | € 6.900 | $ 8 | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 28 5-Year Index | (1,000) | 20.12.2022 | 26.800 | (48) | 0,00 |
| iTraxx Europe Senior 27 5-Year Index | (1,000) | 20.06.2022 | 21.300 | (23) | 0,00 |
| | | | | $ (63) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 33.800 | $ 455 | 0,01 |
| CDX.HY-32 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2024 | 14.200 | 459 | 0,01 |
| | | | | $ 914 | 0,02 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 % | 21.12.2026 | $ 68.790 | $ 1.831 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 27.06.2024 | 96.700 | (882) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 15.06.2026 | 4.400 | (135) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 212.670 | (18.226) | (0,46) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 77.900 | (11.416) | (0,29) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,600 | 26.09.2023 | 156.900 | 8.188 | 0,20 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,700 | 14.12.2023 | 137.700 | 7.117 | 0,18 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,970 | 26.09.2048 | 92.800 | (20.145) | (0,49) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2028 | 44.600 | (2.971) | (0,07) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 51.100 | (339) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 10.400 | (2.242) | (0,06) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2024 | € 4.200 | 20 | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | 163.800 | 3.394 | 0,08 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | 29.800 | (4.738) | (0,12) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2024 | £ 5.800 | (6) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | 380.200 | (8.053) | (0,20) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 | 18.03.2022 | 13.200 | (104) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 2,050 | 23.09.2019 | 29.200 | 1.109 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 18.03.2026 | ¥ 6.050.000 | (291) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 21.03.2028 | 970.000 | (348) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 20.03.2029 | 16.050.000 | (4.854) | (0,12) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,350 | 30.09.2027 | MXN 437.500 | 254 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 3,596 | 15.05.2034 | £ 6.900 | (69) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,579 | 15.10.2033 | 19.400 | 226 | 0,01 |
| | | | | | $ (52.680) | (1,30) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (51.981)** | **(1,30)** |

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

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

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

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

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 % | 18.09.2019 | 6.900 | $ (10) | $ (2) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 4.300 | (7) | (1) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 11.600 | (20) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 21.300 | (41) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 16.000 | (33) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 25.100 | (40) | (7) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 5.500 | (9) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (160) | $ (17) | 0,00 |

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Colombia Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2021 | $ 400 | $ (13) | $ 18 | $ 5 | 0,00 |
| BPS | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 600 | (19) | 27 | 8 | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 100 | (4) | 5 | 1 | 0,00 |
| | UniCredit SpA | 1,000 | 20.06.2023 | € 300 | (41) | 22 | (19) | 0,00 |
| BRC | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2022 | $ 3.900 | 317 | (837) | (520) | (0,01) |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 2.600 | (84) | 117 | 33 | 0,00 |
| CBK | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (6) | 5 | (1) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.400 | (14) | 20 | 6 | 0,00 |
| DUB | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 100 | (3) | 4 | 1 | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 17.800 | (2.239) | (13) | (2.252) | (0,06) |
| GST | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2022 | 3.900 | 320 | (840) | (520) | (0,01) |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 500 | (17) | 6 | (11) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 1.900 | (61) | 85 | 24 | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 2.700 | (11) | 46 | 35 | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 1.600 | (24) | 38 | 14 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 15.000 | (240) | 148 | (92) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 15.500 | (686) | 208 | (478) | (0,01) |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.09.2019 | 3.300 | 5 | 1 | 6 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (6) | 3 | (3) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.700 | (50) | 11 | (39) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 300 | (9) | 13 | 4 | 0,00 |
| JPM | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 400 | (13) | 18 | 5 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 300 | (8) | 7 | (1) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (12) | 8 | (4) | 0,00 |
| MYC | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.09.2019 | 6.800 | (136) | 147 | 11 | 0,00 |
| | California State General Obligation Bonds, Series 2003 | 1,000 | 20.09.2024 | 2.900 | 23 | 83 | 106 | 0,00 |
| | Ohio State General Obligation Bonds, Series 2007 | 1,000 | 20.09.2019 | 1.600 | 47 | (43) | 4 | 0,00 |
| | | | | | $ (2.984) | $ (693) | $ (3.677) | (0,09) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17.11.2059 | $ 800 | $ (24) | $ 30 | $ 6 | 0,00 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 11.000 | (379) | 467 | 88 | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 10.900 | (378) | 466 | 88 | 0,00 |
| | | | | | $ (781) | $ 963 | $ 182 | 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.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Bond Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | DKK | 387.143 | $ | 59.139 | $ 69 | $ 0 | $ 69 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 5.068 | | 5.746 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 35.176 | AUD | 50.370 | 171 | 0 | 171 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 11.254 | CAD | 14.802 | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.216 | £ | 957 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 50.370 | $ | 35.212 | 0 | (173) | (173) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 14.802 | | 11.262 | 0 | (74) | (74) | 0,00 |
| | 09/2019 | ILS | 486 | | 136 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 25.790 | | 18.842 | 0 | (243) | (243) | (0,01) |
| | 10/2019 | DKK | 387.143 | | 59.427 | 0 | (95) | (95) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 103.236 | | 3.292 | 0 | (62) | (62) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € | 3.719 | | 4.171 | 0 | (64) | (64) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 3.182 | | 4.046 | 5 | (9) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 1.236 | | 209 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 18.038 | ARS | 894.609 | 2.192 | 0 | 2.192 | 0,05 |
| | 07/2019 | | 272.113 | € | 239.326 | 431 | 0 | 431 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 90.217 | £ | 71.128 | 307 | 0 | 307 | 0,01 |
| | 08/2019 | € | 239.326 | $ | 272.807 | 0 | (434) | (434) | (0,01) |
| | 08/2019 | £ | 68.749 | | 87.331 | 0 | (301) | (301) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 6.062 | ARS | 270.534 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 360.142 | $ | 304 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 02/2020 | ARS | 453.745 | | 7.579 | 0 | (287) | (287) | (0,01) |
| BRC | 07/2019 | $ | 12.301 | £ | 9.705 | 52 | (2) | 50 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 50.370 | $ | 34.870 | 0 | (477) | (477) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 2.359 | | 2.987 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 1.219.624 | | 11.195 | 0 | (125) | (125) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.823 | PEN | 9.498 | 61 | 0 | 61 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 14.812 | COP | 49.994.172 | 695 | 0 | 695 | 0,02 |
| DUB | 01/2021 | | 1.081 | BRL | 4.740 | 93 | 0 | 93 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 3.287 | $ | 3.723 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 2.140 | | 2.721 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 8.303 | ARS | 390.637 | 805 | 0 | 805 | 0,02 |
| | 08/2019 | RUB | 16.333 | $ | 248 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 247 | MXN | 4.770 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 3.578 | | 69.974 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | ARS | 390.637 | $ | 8.046 | 0 | (1.062) | (1.062) | (0,03) |
| | 07/2019 | CAD | 24.802 | | 18.517 | 0 | (466) | (466) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 228.911 | | 256.232 | 0 | (4.452) | (4.452) | (0,11) |
| | 07/2019 | £ | 57.415 | | 72.791 | 2 | (284) | (282) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 2.725 | ARS | 135.232 | 335 | 0 | 335 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 9.664 | € | 8.500 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 18 | £ | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 16.572 | $ | 846 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 847 | MXN | 16.572 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 330.600 | $ | 10.560 | 0 | (180) | (180) | (0,01) |
| | 01/2021 | BRL | 4.740 | | 731 | 0 | (444) | (444) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | € | 15.236 | | 17.202 | 0 | (149) | (149) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 521 | | 662 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 765.137 | | 7.020 | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.658 | £ | 1.316 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 7.190 | $ | 494 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 69.974 | | 3.572 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 02/2020 | $ | 8.161 | ARS | 453.745 | 0 | (295) | (295) | (0,01) |
| MSB | 09/2019 | | 1.263 | INR | 89.266 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CAD | 102.500 | $ | 77.510 | 0 | (948) | (948) | (0,02) |
| RBC | 08/2019 | MXN | 506.189 | | 25.487 | 0 | (678) | (678) | (0,02) |
| RYL | 07/2019 | £ | 7 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | CAD | 31.800 | | 23.882 | 0 | (459) | (459) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 73.415 | | 92.921 | 0 | (514) | (514) | (0,01) |
| | 11/2019 | TWD | 131.633 | | 4.206 | 0 | (70) | (70) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | ¥ | 218.800 | | 2.026 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 7.300 | | 933 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | $ | 20.473 | ¥ | 2.203.560 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 2.203.560 | $ | 20.521 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 53.403 | | 2.732 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 2.735 | MXN | 53.403 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 5.366 | $ (12.578) | $ (7.212) | (0,18) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 17.726 | $ | 12.379 | $ 0 | $ (60) | $ (60) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 246 | AUD | 354 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 12.392 | | 17.726 | 61 | 0 | 61 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 17.991 | $ | 12.582 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | $ | 12.385 | AUD | 17.890 | $ 169 | $ 0 | $ 169 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 12.408 | | 17.721 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | AUD | 695 | $ | 482 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 171 | AUD | 246 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | | 12.241 | | 17.647 | 143 | 0 | 143 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | AUD | 19 | $ | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 108 | AUD | 155 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | AUD | 137 | $ | 95 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 12.405 | AUD | 17.890 | 150 | 0 | 150 | 0,00 |
| | | | | | | $ 569 | $ (110) | $ 459 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CAD | 15.784 | $ | 12.056 | $ 239 | $ 0 | $ 239 | 0,01 |
| | 07/2019 | $ | 6.008 | CAD | 6.048 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | CAD | 25 | $ | 19 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 15.805 | | 12.099 | 210 | 0 | 210 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.025 | CAD | 6.051 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 8.014 | | 6.133 | 185 | 0 | 185 | 0,00 |
| | | | | | | $ 635 | $ (65) | $ 570 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CHF | 57 | $ | 58 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 27.482 | CHF | 27.565 | 790 | 0 | 790 | 0,02 |
| CBK | 07/2019 | CHF | 28.068 | $ | 28.663 | 0 | (124) | (124) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 27.503 | CHF | 27.562 | 766 | 0 | 766 | 0,02 |
| | 08/2019 | | 28.747 | | 28.068 | 125 | 0 | 125 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 27.513 | | 27.692 | 889 | 0 | 889 | 0,03 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 28.109 | $ | 28.771 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 28.855 | CHF | 28.109 | 60 | 0 | 60 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CHF | 72 | $ | 74 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 21 | | 21 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 942 | CHF | 925 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | | | | | | $ 2.637 | $ (185) | $ 2.452 | 0,07 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 353.628 | $ | 401.863 | $ 0 | $ (849) | $ (849) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ | 402.887 | € | 353.628 | 854 | 0 | 854 | 0,02 |
| BPS | 07/2019 | € | 337.859 | $ | 384.086 | 0 | (668) | (668) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 4.357 | € | 3.854 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 378.676 | | 332.202 | 602 | 0 | 602 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | | 368.227 | | 329.224 | 6.693 | 0 | 6.693 | 0,17 |
| CBK | 07/2019 | € | 354.730 | $ | 403.150 | 1 | (818) | (817) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 23.767 | € | 20.905 | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 402.924 | | 353.628 | 817 | 0 | 817 | 0,02 |
| GLM | 07/2019 | | 343.095 | | 307.214 | 6.761 | 0 | 6.761 | 0,17 |
| MYI | 07/2019 | | 368.138 | | 329.224 | 6.782 | 0 | 6.782 | 0,17 |
| RBC | 07/2019 | | 368 | | 325 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | € | 7.780 | $ | 8.798 | 0 | (62) | (62) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 39.765 | € | 35.148 | 262 | 0 | 262 | 0,01 |
| SCX | 07/2019 | € | 544 | $ | 610 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 920 | € | 816 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 8.847 | | 7.830 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 40.458 | | 36.182 | 745 | 0 | 745 | 0,02 |
| | | | | | | $ 23.667 | $ (2.406) | $ 21.261 | 0,53 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class E 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 1.307 | £ | 1.042 | $ 19 | $ 0 | $ 19 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 315.807 | $ | 400.555 | 0 | (1.371) | (1.371) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 96.782 | £ | 76.312 | 341 | 0 | 341 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 401.151 | | 315.793 | 1.384 | 0 | 1.384 | 0,03 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | £ 314.151 | $ 399.159 | $ 0 | $ (660) | $ (660) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ 376.011 | £ 296.718 | 1.639 | (17) | 1.622 | 0,04 |
| | 08/2019 | 399.771 | 314.151 | 671 | 0 | 671 | 0,02 |
| GLM | 07/2019 | £ 5.631 | $ 7.118 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 146 | £ 115 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 156 | 123 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 366.997 | 289.956 | 2.031 | 0 | 2.031 | 0,05 |
| SSB | 07/2019 | 362.667 | 287.023 | 2.627 | 0 | 2.627 | 0,07 |
| | | | | $ 8.713 | $ (2.097) | $ 6.616 | 0,17 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ 25 | NOK 220 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | 8.040 | 70.491 | 227 | 0 | 227 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | NOK 72.149 | $ 8.480 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 8.489 | NOK 72.149 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | NOK 71.949 | $ 8.457 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 8.466 | NOK 71.949 | 0 | (18) | (18) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | 8.239 | 72.042 | 211 | 0 | 211 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | 13 | 113 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | NOK 4 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | $ 8.401 | NOK 73.470 | 217 | (1) | 216 | 0,01 |
| | | | | $ 692 | $ (37) | $ 655 | 0,02 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | $ 21.629 | SEK 206.013 | $ 575 | $ 0 | $ 575 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | SEK 688 | $ 73 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| IND | 07/2019 | $ 21.743 | SEK 208.417 | 721 | 0 | 721 | 0,02 |
| JPM | 07/2019 | SEK 208.063 | $ 22.426 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 22.479 | SEK 208.063 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | SEK 1.731 | $ 184 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 42 | SEK 400 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SEK 207.841 | $ 22.412 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 21.781 | SEK 208.417 | 682 | 0 | 682 | 0,02 |
| | 08/2019 | 22.464 | 207.841 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | | | | $ 1.991 | $ (16) | $ 1.975 | 0,05 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 23.264** | **0,58** |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Barclays Bank PLC** 2,980 % fällig am 25.10.2019 | $ 5.500 | $ 5.506 | 0,14 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 5.506** | **0,14** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 4.031.510** | **101,15** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (45.728)** | **(1,15)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 3.985.782** | **100,00** |

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

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

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(e) Nullkuponwertpapier.

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

(g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

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

**(i) Mit dem Fonds verbunden.**

**(j) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 5.876 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 145 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 61.620 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 10.350 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(l) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 990 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | $ (1.013) | $ 990 | $ 990 | 0,02 |
| NOM | 2,380 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 8.700 | U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.08.2045 | (8.897) | 8.700 | 8.702 | 0,23 |
| RDR | 2,550 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 8.000 | U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.05.2021 | (8.172) | 8.000 | 8.002 | 0,20 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (18.082)** | **$ 17.690** | **$ 17.694** | **0,45** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 379.876 | $ 3.674.540 | $ 4.987 | $ 4.059.403 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 5.506 | 0 | 5.506 |
| Finanzderivate[3] | (4.682) | (28.717) | 0 | (33.399) |
| **Summen** | **$ 375.194** | **$ 3.651.329** | **$ 4.987** | **$ 4.031.510** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 266.294 | $ 3.693.840 | $ 8.158 | $ 3.968.292 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 5.503 | 0 | 5.503 |
| Finanzderivate[3] | 7.688 | (18.663) | 0 | (10.975) |
| **Summen** | **$ 273.982** | **$ 3.680.680** | **$ 8.158** | **$ 3.962.820** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlich-keiten aus Pension-sgeschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| CFR | 2,550 % | 19.06.2019 | TBD[1] | $ (5.792) | $ (5.797) | (0,15) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (5.797)** | **(0,15)** |

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/ verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 665 | $ (830) | $ (165) |
| BPS | 2.360 | (2.440) | (80) |
| BRC | 6.254 | (5.570) | 684 |
| CBK | 3.324 | (1.800) | 1.524 |
| CKL | (1) | 0 | (1) |
| DUB | (2.158) | 1.870 | (288) |
| GLM | 8.373 | (7.820) | 553 |
| GST | (1.035) | 1.150 | 115 |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| HUS | $ (6.383) | $ 5.520 | $ (863) |
| IND | 864 | (700) | 164 |
| JPM | (328) | 530 | 202 |
| MSB | 18 | 0 | 18 |
| MYC | 209 | (699) | (490) |
| MYI | 5.835 | (5.530) | 305 |
| RBC | (677) | 760 | 83 |
| RYL | 198 | (350) | (152) |
| SCX | 2.035 | (1.050) | 985 |
| SSB | 2.880 | (1.290) | 1.590 |
| TOR | 745 | (560) | 185 |
| UAG | 87 | 0 | 87 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 50,21 | 55,05 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 51,20 | 73,36 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,44 | 0,13 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,12) | 0,25 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,30) | (0,37) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,58 | (0,24) |
| Einlagenzertifikate | 0,14 | 0,18 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,15) | (7,11) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 0,85 | 1,20 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 26,67 | 25,90 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,32 | 0,40 |
| US-Regierungsbehörden | 15,22 | 23,70 |
| US-Schatzobligationen | 20,93 | 28,08 |
| Non-Agency-MBS | 6,69 | 8,47 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 14,01 | 18,25 |
| Staatsemissionen | 3,10 | 2,50 |
| Investmentfonds | 2,43 | 2,83 |
| Stammaktien | 0,02 | 0,01 |
| Vorzugswertpapiere | 0,06 | 0,07 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 3,38 | 4,34 |
| Kurzfristige Instrumente | 4,45 | 11,34 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 3,72 | 1,45 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,12) | 0,25 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,02) | (0,05) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | 0,02 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,02 | 0,00 |
| Zinsswaps | (1,30) | (0,34) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,09) | (0,06) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,00 | (0,01) |
| Devisenterminkontrakte | (0,18) | (0,14) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,85 | (0,03) |
| Einlagenzertifikate | 0,14 | 0,18 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (1,15) | (28,36) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Dynamic Multi-Asset Fund



| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | |
| 0,080 % fällig am 03.12.2021 | € 5.200 | € 5.232 | 0,39 |
| **Akelius Residential Property AB** | | | |
| 1,500 % fällig am 23.01.2022 | 400 | 414 | 0,03 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | $ 100 | 89 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2020 | 100 | 91 | 0,01 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | € 3.500 | 3.753 | 0,28 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (e | 1.400 | 1.441 | 0,11 |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 0,389 % fällig am 25.04.2024 | 4.500 | 4.524 | 0,33 |
| 2,500 % fällig am 27.07.2020 | 3.900 | 4.012 | 0,30 |
| **Barclays PLC** | | | |
| 1,875 % fällig am 23.03.2021 | 10.100 | 10.412 | 0,77 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | |
| 1,400 % fällig am 06.07.2022 | 3.800 | 3.892 | 0,29 |
| **BNG Bank NV** | | | |
| 1,875 % fällig am 14.01.2021 | 5.500 | 5.706 | 0,42 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | |
| 0,090 % fällig am 15.01.2020 | 900 | 902 | 0,07 |
| **Cajamar Caja Rural SCC** | | | |
| 0,875 % fällig am 18.06.2023 | 1.700 | 1.762 | 0,13 |
| **Castellum AB** | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | 500 | 530 | 0,04 |
| **China Evergrande Group** | | | |
| 8,750 % fällig am 28.06.2025 | $ 4.000 | 3.123 | 0,23 |
| **Citigroup, Inc.** | | | |
| 5,000 % fällig am 02.08.2019 | € 4.300 | 4.320 | 0,32 |
| 7,375 % fällig am 04.09.2019 | 4.200 | 4.257 | 0,32 |
| **Commerzbank AG** | | | |
| 0,050 % fällig am 01.08.2022 | 1.900 | 1.928 | 0,14 |
| 0,125 % fällig am 09.01.2024 | 5.500 | 5.610 | 0,42 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (e)(g) | 400 | 417 | 0,03 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (e)(g) | 400 | 444 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 (g) | 3.000 | 3.149 | 0,23 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | 3.800 | 3.859 | 0,29 |
| **Deutsche Bank AG** | | | |
| 1,250 % fällig am 08.09.2021 | 4.000 | 4.007 | 0,30 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | 2.700 | 2.723 | 0,20 |
| **Deutsche Pfandbriefbank AG** | | | |
| 1,625 % fällig am 30.08.2019 | $ 4.400 | 3.860 | 0,29 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | |
| 0,250 % fällig am 19.03.2020 | € 13.500 | 13.568 | 1,00 |
| 0,250 % fällig am 01.06.2023 | 8.100 | 8.272 | 0,61 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | 900 | 983 | 0,07 |
| **DNB Boligkreditt A/S** | | | |
| 0,375 % fällig am 14.11.2023 | 3.800 | 3.908 | 0,29 |
| **Dream Global Funding SARL** | | | |
| 1,375 % fällig am 21.12.2021 | 100 | 102 | 0,01 |
| **Easy Tactic Ltd.** | | | |
| 5,875 % fällig am 13.02.2023 | $ 1.100 | 924 | 0,07 |
| 8,125 % fällig am 27.02.2023 | 4.200 | 3.757 | 0,28 |
| **Euroclear Bank S.A.** | | | |
| 0,077 % fällig am 08.03.2021 | € 3.000 | 3.012 | 0,22 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | |
| 0,200 % fällig am 17.01.2024 | 5.700 | 5.859 | 0,43 |
| **Europäischer Stabilitätsmechanismus** | | | |
| 0,000 % fällig am 17.01.2022 (c) | 3.700 | 3.752 | 0,28 |
| **Fastighets AB Balder** | | | |
| 1,125 % fällig am 14.03.2022 | 200 | 204 | 0,01 |
| **FCE Bank PLC** | | | |
| 0,189 % fällig am 26.08.2020 | 2.900 | 2.888 | 0,21 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | $ 5.000 | 4.418 | 0,33 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | € 100 | € 98 | 0,01 |
| 0,100 % fällig am 07.12.2022 | 800 | 769 | 0,06 |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | 200 | 198 | 0,01 |
| **GE Capital European Funding Unlimited Co.** | | | |
| 5,375 % fällig am 23.01.2020 | 2.700 | 2.782 | 0,21 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | |
| 0,207 % fällig am 26.03.2022 | 400 | 395 | 0,03 |
| 0,372 % fällig am 10.05.2021 | 300 | 301 | 0,02 |
| 3,442 % fällig am 09.04.2021 | $ 800 | 702 | 0,05 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 0,132 % fällig am 16.12.2020 | € 5.000 | 5.006 | 0,37 |
| 2,625 % fällig am 19.08.2020 | 3.800 | 3.919 | 0,29 |
| 3,688 % fällig am 15.11.2021 | $ 4.500 | 3.985 | 0,30 |
| **IMMOFINANZ AG** | | | |
| 2,625 % fällig am 27.01.2023 | € 1.700 | 1.778 | 0,13 |
| **ING Bank NV** | | | |
| 0,090 % fällig am 08.04.2021 | 3.000 | 3.014 | 0,22 |
| 0,750 % fällig am 22.02.2021 | 3.000 | 3.046 | 0,23 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | $ 100 | 95 | 0,01 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | |
| 7,000 % fällig am 19.01.2021 (e)(g) | € 1.600 | 1.688 | 0,12 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | |
| 1,875 % fällig am 21.11.2019 | 4.400 | 4.438 | 0,33 |
| 2,625 % fällig am 23.04.2021 | 2.500 | 2.627 | 0,19 |
| 3,875 % fällig am 23.09.2020 | 4.000 | 4.202 | 0,31 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK 86.500 | 11.636 | 0,86 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | |
| 0,500 % fällig am 15.09.2027 | € 10.000 | 10.545 | 0,78 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | |
| 1,000 % fällig am 24.05.2021 | 10.700 | 10.900 | 0,81 |
| **Logicor Financing SARL** | | | |
| 0,500 % fällig am 30.04.2021 | 3.200 | 3.228 | 0,24 |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | 2.800 | 2.898 | 0,21 |
| **Morgan Stanley** | | | |
| 0,087 % fällig am 21.05.2021 | 5.000 | 5.008 | 0,37 |
| **Nasdaq, Inc.** | | | |
| 3,850 % fällig am 30.06.2026 | $ 100 | 92 | 0,01 |
| **Natwest Markets PLC** | | | |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | € 2.900 | 2.916 | 0,22 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | $ 400 | 364 | 0,03 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | |
| 2,000 % fällig am 01.04.2020 | DKK 70.000 | 9.585 | 0,71 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | |
| 0,250 % fällig am 02.06.2022 | € 2.800 | 2.784 | 0,21 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK 86.500 | 11.636 | 0,86 |
| **PKO Bank Hipoteczny S.A.** | | | |
| 0,250 % fällig am 23.11.2021 | € 800 | 808 | 0,06 |
| **Prologis LP** | | | |
| 1,375 % fällig am 07.10.2020 | 900 | 914 | 0,07 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | |
| 3,576 % fällig am 02.05.2022 | $ 5.000 | 4.423 | 0,33 |
| **RCI Banque S.A.** | | | |
| 0,340 % fällig am 12.04.2021 | € 1.000 | 1.004 | 0,07 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | |
| 1,000 % fällig am 01.01.2022 | DKK 30.000 | 4.177 | 0,31 |
| **RKPF Overseas 2019 A Ltd.** | | | |
| 7,875 % fällig am 01.02.2023 | $ 2.300 | 2.124 | 0,16 |
| **RKPF Overseas 2019 B Ltd.** | | | |
| 7,750 % fällig am 18.04.2021 | 2.600 | 2.388 | 0,18 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget Norden AB** | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2025 | € 200 | 204 | 0,01 |
| **Scenery Journey Ltd.** | | | |
| 11,000 % fällig am 06.11.2020 | $ 4.000 | 3.657 | 0,27 |
| **Societe Generale S.A.** | | | |
| 0,000 % fällig am 27.05.2022 (c) | € 5.000 | 5.008 | 0,37 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | |
| 6,500 % (e) | 1.000 | 1.227 | 0,09 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | |
| 7,350 % fällig am 19.07.2021 | $ 4.200 | 3.781 | 0,28 |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 | 3.100 | 2.795 | 0,21 |
| 8,375 % fällig am 15.01.2021 | 400 | 364 | 0,03 |
| 8,625 % fällig am 27.07.2020 | 600 | 543 | 0,04 |
| **Vesteda Finance BV** | | | |
| 2,500 % fällig am 27.10.2022 | € 100 | € 107 | 0,01 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | |
| 0,102 % fällig am 15.06.2021 | 400 | 400 | 0,03 |
| 0,625 % fällig am 08.09.2021 | 400 | 404 | 0,03 |
| 1,159 % fällig am 01.08.2022 | 400 | 407 | 0,03 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | |
| 0,250 % fällig am 16.10.2020 | 1.900 | 1.907 | 0,14 |
| 0,489 % fällig am 15.02.2021 | 700 | 704 | 0,05 |
| 0,625 % fällig am 01.04.2022 | 1.000 | 1.009 | 0,07 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | |
| 0,140 % fällig am 06.07.2021 | 1.800 | 1.797 | 0,13 |
| 0,250 % fällig am 16.02.2021 | 4.000 | 4.013 | 0,30 |
| 0,750 % fällig am 11.08.2020 | 5.000 | 5.043 | 0,37 |
| **Vonovia Finance BV** | | | |
| 0,875 % fällig am 30.03.2020 | 3.000 | 3.023 | 0,22 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | |
| 2,250 % fällig am 03.09.2020 | 8.500 | 8.742 | 0,65 |
| | | 303.712 | 22,50 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| **ABB Finance BV** | | | |
| 0,040 % fällig am 12.10.2020 | 3.000 | 3.009 | 0,22 |
| **Allergan Funding SCS** | | | |
| 0,039 % fällig am 15.11.2020 | 4.100 | 4.099 | 0,30 |
| **Altice Luxemburg S.A.** | | | |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | 858 | 881 | 0,06 |
| **Apple, Inc.** | | | |
| 2,885 % fällig am 11.05.2022 | $ 7.000 | 6.183 | 0,46 |
| **B.A.T International Finance PLC** | | | |
| 4,000 % fällig am 07.07.2020 | € 3.000 | 3.124 | 0,23 |
| **Bayer Capital Corp. BV** | | | |
| 0,207 % fällig am 26.06.2022 | 5.000 | 4.983 | 0,37 |
| **BMW Finance NV** | | | |
| 0,250 % fällig am 14.01.2022 | 800 | 807 | 0,06 |
| 0,625 % fällig am 06.10.2023 | 900 | 919 | 0,07 |
| **Coca-Cola Co.** | | | |
| 0,125 % fällig am 22.09.2022 | 500 | 504 | 0,04 |
| **CRH Finland Services OYJ** | | | |
| 2,750 % fällig am 15.10.2020 | 1.600 | 1.648 | 0,12 |
| **Diageo Finance PLC** | | | |
| 0,250 % fällig am 22.10.2021 | 700 | 707 | 0,05 |
| **Discovery Communications LLC** | | | |
| 3,097 % fällig am 20.09.2019 | $ 5.000 | 4.396 | 0,33 |
| **Essity AB** | | | |
| 0,500 % fällig am 26.05.2021 | € 3.600 | 3.643 | 0,27 |
| **Hochtief AG** | | | |
| 3,875 % fällig am 20.03.2020 | 200 | 206 | 0,02 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | |
| 2,250 % fällig am 26.02.2021 | 11.165 | 11.528 | 0,85 |
| **ISS Global A/S** | | | |
| 1,125 % fällig am 09.01.2020 | 2.900 | 2.910 | 0,22 |
| **Medtronic Global Holdings S.C.A.** | | | |
| 0,375 % fällig am 07.03.2023 | 300 | 304 | 0,02 |
| **ProSiebenSat.1 Media SE** | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2021 | 800 | 829 | 0,06 |
| **Smurfit Kappa Acquisitions ULC** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.01.2026 | 500 | 545 | 0,04 |
| **Stryker Corp.** | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2020 | 900 | 901 | 0,07 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | |
| 0,237 % fällig am 21.11.2020 | 3.000 | 3.012 | 0,22 |
| 0,375 % fällig am 21.11.2020 | 500 | 504 | 0,04 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | |
| 3,197 % fällig am 19.01.2023 | $ 200 | 174 | 0,01 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Niederlande BV** | | | |
| 0,375 % fällig am 25.07.2020 | € 500 | 492 | 0,04 |
| **UCB S.A.** | | | |
| 1,875 % fällig am 02.04.2022 | 200 | 208 | 0,02 |
| **United Group BV** | | | |
| 4,375 % fällig am 01.07.2022 | 800 | 820 | 0,06 |
| **Wind Tre SpA** | | | |
| 2,625 % fällig am 20.01.2023 | 300 | 303 | 0,02 |
| 2,750 % fällig am 20.01.2024 | 1.900 | 1.879 | 0,14 |
| | | 59.518 | 4,41 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 0,090 % fällig am 03.08.2020 | € | 3.000 | € 3.007 | 0,23 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 0,625 % fällig am 10.03.2021 | | 9.900 | 10.023 | 0,74 |
| **Optus Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.06.2029 | | 700 | 711 | 0,05 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 17.10.2020 | | 1.400 | 1.447 | 0,11 |
| | | | 15.188 | 1,13 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 378.418 | 28,04 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 4,398 % fällig am 25.04.2035 | $ | 104 | 94 | 0,01 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.11.2046 | | 115 | 91 | 0,01 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 3,054 % fällig am 25.09.2047 | | 334 | 278 | 0,02 |
| 4,935 % fällig am 26.03.2037 | | 946 | 843 | 0,06 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 4,003 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 1.000 | 814 | 0,06 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 4,018 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 7.900 | 5.628 | 0,42 |
| 4,129 % fällig am 25.07.2034 | | 840 | 749 | 0,06 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,291 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 125 | 107 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.02.2047 | | 109 | 93 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.08.2035 | | 1.268 | 1.088 | 0,08 |
| 3,988 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 1.500 | 1.250 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 | | 407 | 301 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 145 | 91 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 552 | 398 | 0,03 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,984 % fällig am 25.04.2035 | | 3.334 | 2.854 | 0,21 |
| 3,004 % fällig am 25.05.2035 | | 269 | 222 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 139 | 103 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037 | | 127 | 86 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 4,946 % fällig am 25.01.2034 ^ | | 978 | 839 | 0,06 |
| **Dilosk RMBS DAC** | | | | |
| 0,520 % fällig am 20.10.2057 | € | 500 | 501 | 0,04 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,580 % fällig am 19.10.2036 | $ | 160 | 125 | 0,01 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.10.2045 | | 1.780 | 1.548 | 0,11 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.03.2035 | | 3.367 | 2.763 | 0,20 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,504 % fällig am 19.10.2035 | | 127 | 86 | 0,01 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | | 127 | 111 | 0,01 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 141 | 121 | 0,01 |
| 2,694 % fällig am 25.01.2036 | | 799 | 593 | 0,04 |
| 3,754 % fällig am 25.08.2037 | | 4.218 | 3.166 | 0,23 |
| 4,148 % fällig am 25.06.2036 | | 2.953 | 2.284 | 0,17 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.08.2037 | | 4.587 | 3.981 | 0,29 |
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | | |
| 2,450 % fällig am 25.05.2042 | | 210 | 170 | 0,01 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,500 % fällig am 25.05.2058 | | 941 | 877 | 0,06 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 | | 194 | 164 | 0,01 |
| **SapphireOne Mortgages FCT** | | | | |
| 0,189 % fällig am 25.02.2061 | € | 2.211 | 2.213 | 0,16 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.06.2044 | $ | 760 | 679 | 0,05 |
| 3,957 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 92 | 81 | 0,01 |
| | | | 35.392 | 2,62 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,945 % fällig am 25.09.2035 | $ | 2.800 | € 2.267 | 0,17 |
| **Accunia European CLO BV** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 1.400 | 1.403 | 0,10 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.04.2036 | $ | 625 | 541 | 0,04 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 271 | 115 | 0,01 |
| **Adagio CLO Ltd.** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2029 | € | 300 | 301 | 0,02 |
| **Arbour CLO DAC** | | | | |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 1.600 | 1.600 | 0,12 |
| **Asset-Backed European Securitisation Transaction** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.12.2028 | | 2.000 | 2.008 | 0,15 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,680 % fällig am 13.10.2029 | | 600 | 599 | 0,04 |
| 0,800 % fällig am 26.04.2029 | | 500 | 500 | 0,04 |
| **Babson Euro CLO BV** | | | | |
| 0,509 % fällig am 25.10.2029 | | 450 | 448 | 0,03 |
| **Barings Euro CLO BV** | | | | |
| 0,680 % fällig am 27.07.2030 | | 600 | 599 | 0,04 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.08.2037 | $ | 263 | 204 | 0,02 |
| **Black Diamond CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € | 800 | 801 | 0,06 |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 400 | 401 | 0,03 |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | | 5.000 | 5.006 | 0,37 |
| 0,930 % fällig am 30.04.2031 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,870 % fällig am 18.01.2030 | | 2.500 | 2.500 | 0,19 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.01.2036 | $ | 18.000 | 15.172 | 1,12 |
| **Cars Alliance Auto Loans Frankreich** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.10.2029 | € | 4.500 | 4.512 | 0,33 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,404 % fällig am 25.10.2037 | $ | 1.241 | 1.148 | 0,09 |
| 6,750 % fällig am 25.05.2036 | | 163 | 107 | 0,01 |
| **Contego CLO BV** | | | | |
| 0,599 % fällig am 15.11.2026 | € | 199 | 199 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.08.2037 | $ | 9.302 | 8.065 | 0,60 |
| 2,594 % fällig am 25.11.2037 | | 974 | 850 | 0,06 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 138 | 101 | 0,01 |
| 3,274 % fällig am 25.04.2034 | | 1.240 | 1.088 | 0,08 |
| 3,979 % fällig am 25.01.2034 | | 294 | 258 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.** | | | | |
| 3,829 % fällig am 25.06.2034 | | 504 | 438 | 0,03 |
| **CVC Cordatus Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 0,970 % fällig am 22.04.2030 | € | 1.500 | 1.506 | 0,11 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | | 700 | 701 | 0,05 |
| **Driver Espana FT** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.12.2028 | | 1.263 | 1.268 | 0,09 |
| 0,011 % fällig am 21.04.2028 | | 496 | 498 | 0,04 |
| **Driver Multi-Compartment S.A.** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.08.2026 | | 2.131 | 2.139 | 0,16 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | | |
| 0,880 % fällig am 15.01.2030 | | 2.600 | 2.603 | 0,19 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.10.2027 | $ | 900 | 789 | 0,06 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | € | 1.100 | 1.100 | 0,08 |
| **Euro-Galaxy CLO BV** | | | | |
| 1,140 % fällig am 10.11.2030 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **FCT Titrisocram** | | | | |
| 0,082 % fällig am 25.07.2036 | | 743 | 745 | 0,06 |
| **FCT Youni** | | | | |
| 0,008 % fällig am 25.04.2032 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.11.2036 | $ | 10.000 | 7.967 | 0,59 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 | | 522 | 295 | 0,02 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | € | 500 | 500 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 2,454 % fällig am 25.12.2046 | $ | 1.695 | € 1.003 | 0,07 |
| 5,985 % fällig am 25.06.2036 | | 1.438 | 584 | 0,04 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 450 | 450 | 0,03 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | | 700 | 698 | 0,05 |
| 0,530 % fällig am 12.07.2028 | | 600 | 600 | 0,04 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 3,184 % fällig am 25.02.2034 | $ | 2.009 | 1.752 | 0,13 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,529 % fällig am 25.07.2036 | | 214 | 165 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 332 | 147 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,504 % fällig am 25.04.2037 | | 139 | 82 | 0,01 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.09.2037 | | 304 | 261 | 0,02 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.03.2037 | | 285 | 229 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.04.2037 | | 710 | 496 | 0,04 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | | 516 | 314 | 0,02 |
| 3,184 % fällig am 25.11.2034 | | 792 | 698 | 0,05 |
| **Orwell Park CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,780 % fällig am 18.07.2029 | € | 300 | 300 | 0,02 |
| **Penta CLO BV** | | | | |
| 0,790 % fällig am 04.08.2028 | | 1.190 | 1.191 | 0,09 |
| **Red & Black Auto Lease Deutschland S.A.** | | | | |
| 0,024 % fällig am 15.11.2027 | | 243 | 243 | 0,02 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,285 % fällig am 25.01.2037 | $ | 229 | 106 | 0,01 |
| 5,545 % fällig am 25.01.2037 | | 336 | 164 | 0,01 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,744 % fällig am 25.05.2037 | | 3.000 | 2.627 | 0,20 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,694 % fällig am 25.09.2036 | | 7.500 | 6.221 | 0,46 |
| **SC Deutschland Auto UG** | | | | |
| 0,023 % fällig am 13.12.2026 | € | 406 | 407 | 0,03 |
| 0,023 % fällig am 13.12.2027 | | 1.904 | 1.911 | 0,14 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 2,834 % fällig am 25.10.2035 | $ | 3.965 | 3.464 | 0,26 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | | |
| 0,024 % fällig am 16.03.2026 | € | 1.914 | 1.920 | 0,14 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.03.2037 | $ | 117 | 99 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.07.2037 | | 1.245 | 926 | 0,07 |
| 2,574 % fällig am 25.08.2037 | | 1.334 | 1.080 | 0,08 |
| 2,654 % fällig am 25.10.2036 | | 200 | 170 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.10.2037 | | 2.940 | 2.162 | 0,16 |
| **St Paul's CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 20.08.2030 | € | 5.000 | 5.004 | 0,37 |
| **THL Credit Wind River CLO Ltd.** | | | | |
| 4,047 % fällig am 15.01.2026 | $ | 499 | 438 | 0,03 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,600 % fällig am 04.08.2028 | € | 400 | 400 | 0,03 |
| 0,880 % fällig am 07.12.2029 (a) | | 1.500 | 1.500 | 0,11 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 15.10.2030 | | 5.000 | 5.012 | 0,37 |
| **Tymon Park CLO Ltd.** | | | | |
| 0,590 % fällig am 21.01.2029 | | 200 | 200 | 0,02 |
| **VCL Multi-Compartment S.A.** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.08.2024 | | 3.752 | 3.764 | 0,28 |
| 0,009 % fällig am 21.01.2025 | | 834 | 837 | 0,06 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | $ | 882 | 778 | 0,06 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.10.2034 | | 220 | 191 | 0,01 |
| | | | 120.236 | 8,91 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | € | 200 | 206 | 0,02 |
| **China Development Bank** | | | | |
| 0,125 % fällig am 03.11.2019 | | 5.000 | 5.005 | 0,37 |
| **Cyprus Government International Bond** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.07.2023 | | 1.400 | 1.607 | 0,12 |
| 3,875 % fällig am 06.05.2022 | | 7.300 | 8.108 | 0,60 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| Export-Import Bank of China 0,250 % fällig am 02.12.2019 | € | 200 | € 200 | 0,01 |
| Iceland Government International Bond 0,500 % fällig am 20.12.2022 | | 2.500 | 2.562 | 0,19 |
| Indonesien Government International Bond 3,750 % fällig am 14.06.2028 | | 5.400 | 6.461 | 0,48 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,650 % fällig am 01.11.2020 | | 7.675 | 7.742 | 0,57 |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesien 3,400 % fällig am 29.03.2021 | $ | 400 | 356 | 0,03 |
| Land Rheinland-Pfalz 0,000 % fällig am 16.09.2019 (c) | € | 1.350 | 1.351 | 0,10 |
| Stockholms Lans Landsting 0,750 % fällig am 26.02.2025 | | 7.000 | 7.380 | 0,55 |
| | | | 40.978 | 3,04 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (f) | 4.979.916 | 69.092 | 5,12 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (f) | 1.111.442 | 11.429 | 0,85 |
| | | 80.521 | 5,97 |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Bilibili, Inc. ADR (b) | 87.900 | 1.256 | 0,09 |
| Momo, Inc. ADR | 132.800 | 4.175 | 0,31 |
| Tencent Holdings Ltd. | 151.400 | 6.014 | 0,45 |
| Twitter, Inc. (b) | 277.600 | 8.507 | 0,63 |
| Yahoo Japan Corp. | 784.320 | 2.027 | 0,15 |
| | | 21.979 | 1,63 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Alibaba Group Holding Ltd. SP - ADR (b) | 20.300 | 3.021 | 0,22 |
| ANTA Sports Products Ltd. | 652.000 | 3.948 | 0,29 |
| Ctrip.com International Ltd. (b) | 74.000 | 2.398 | 0,18 |
| Denso Corp. | 55.680 | 2.063 | 0,15 |
| Fast Retailing Co. Ltd. | 6.080 | 3.234 | 0,24 |
| JD.com, Inc. (b) | 107.300 | 2.854 | 0,21 |
| Mitsubishi Motors Corp. | 353.000 | 1.490 | 0,11 |
| Panasonic Corp. | 213.860 | 1.570 | 0,12 |
| Pinduoduo, Inc. ADR (b) | 127.100 | 2.303 | 0,17 |
| Sony Corp. | 51.670 | 2.386 | 0,18 |
| Subaru Corp. | 95.920 | 2.052 | 0,15 |
| Suzuki Motor Corp. | 47.510 | 1.964 | 0,15 |
| | | 29.283 | 2,17 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Amgen, Inc. | 46.360 | 7.502 | 0,56 |
| Anthem, Inc. | 34.830 | 8.631 | 0,64 |
| Astellas Pharma, Inc. | 207.800 | 2.602 | 0,19 |
| Bristol-Myers Squibb Co. | 144.700 | 5.762 | 0,43 |
| Gilead Sciences, Inc. | 104.440 | 6.196 | 0,46 |
| Humana, Inc. | 54.470 | 12.690 | 0,94 |
| Shionogi & Co. Ltd. | 53.450 | 2.714 | 0,20 |
| | | 46.097 | 3,42 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| FANUC Corp. | 14.030 | 2.291 | 0,17 |
| Mitsubishi Electric Corp. | 205.370 | 2.385 | 0,18 |
| Secom Co. Ltd. | 35.960 | 2.723 | 0,20 |
| SMC Corp. | 10.200 | 3.360 | 0,25 |
| | | 10.759 | 0,80 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Accenture PLC 'A' | 53.930 | € 8.750 | 0,65 |
| Apple, Inc. | 110.740 | 19.246 | 1,43 |
| Automatic Data Processing, Inc. | 37.460 | 5.438 | 0,40 |
| Cisco Systems, Inc. | 270.910 | 13.020 | 0,96 |
| Cognizant Technology Solutions Corp. 'A' | 76.190 | 4.241 | 0,31 |
| Electronic Arts, Inc. (b) | 147.020 | 13.073 | 0,97 |
| Fujitsu Ltd. | 41.252 | 2.533 | 0,19 |
| Kyocera Corp. | 55.600 | 3.201 | 0,24 |
| Lam Research Corp. | 22.970 | 3.789 | 0,28 |
| Micron Technology, Inc. (b) | 365.500 | 12.386 | 0,92 |
| Microsoft Corp. | 128.770 | 15.148 | 1,12 |
| Nexon Co. Ltd. | 198.900 | 2.553 | 0,19 |
| NVIDIA Corp. | 64.160 | 9.253 | 0,68 |
| QUALCOMM, Inc. | 251.500 | 16.800 | 1,24 |
| Tokyo Electron Ltd. | 16.170 | 1.997 | 0,15 |
| Xilinx, Inc. | 69.900 | 7.238 | 0,54 |
| | | 138.666 | 10,27 |
| **GRUNDSTOFFE** | | | |
| Nitto Denko Corp. | 38.100 | 1.657 | 0,12 |
| Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. | 28.360 | 2.332 | 0,17 |
| | | 3.989 | 0,29 |
| | | 250.773 | 18,58 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF (f) | 1.851.500 | 18.840 | 1,39 |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (f) | 312.400 | 31.309 | 2,32 |
| | | 50.149 | 3,71 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| APRR S.A. (0,289) % fällig am 01.07.2019 | € | 3.000 | 3.000 | 0,22 |
| (0,324) % fällig am 30.09.2019 | | 3.000 | 3.004 | 0,22 |
| Bank of Montreal 1,787 % fällig am 22.07.2019 | CAD | 600 | 403 | 0,03 |
| 1,797 % fällig am 19.07.2019 | | 400 | 269 | 0,02 |
| 1,800 % fällig am 24.07.2019 | | 1.200 | 805 | 0,06 |
| 1,802 % fällig am 26.07.2019 | | 3.800 | 2.550 | 0,19 |
| Bank of Nova Scotia 1,773 % fällig am 22.07.2019 | | 1.000 | 671 | 0,05 |
| 1,775 % fällig am 23.07.2019 | | 200 | 134 | 0,01 |
| 1,775 % fällig am 25.07.2019 | | 400 | 268 | 0,02 |
| 1,781 % fällig am 26.07.2019 | | 100 | 67 | 0,01 |
| 1,785 % fällig am 22.07.2019 | | 900 | 604 | 0,05 |
| 1,802 % fällig am 25.07.2019 | | 15.000 | 10.067 | 0,75 |
| BAT International Finance PLC 2,900 % fällig am 08.07.2019 | $ | 7.000 | 6.143 | 0,46 |
| Bayer (0,213) % fällig am 17.07.2019 | € | 3.000 | 3.001 | 0,22 |
| (0,208) % fällig am 26.08.2019 | | 7.000 | 7.006 | 0,52 |
| Boston Scientific Corp. 2,910 % fällig am 09.07.2019 | $ | 1.200 | 1.053 | 0,08 |
| Broadcom, Inc. 2,830 % fällig am 18.07.2019 | | 8.400 | 7.365 | 0,55 |
| 2,870 % fällig am 16.07.2019 | $ | 500 | € 439 | 0,03 |
| 2,910 % fällig am 09.07.2019 | | 1.100 | 965 | 0,07 |
| Campbell Soup Co. 2,980 % fällig am 15.07.2019 | | 250 | 219 | 0,02 |
| 3,100 % fällig am 14.08.2019 | | 800 | 700 | 0,05 |
| 3,100 % fällig am 21.08.2019 | | 5.000 | 4.374 | 0,32 |
| Crown Castle International Corp. 2,800 % fällig am 17.07.2019 | | 400 | 351 | 0,03 |
| Encana Corp. 3,120 % fällig am 08.07.2019 | | 300 | 263 | 0,02 |
| 3,200 % fällig am 01.08.2019 | | 800 | 701 | 0,05 |
| Energie Transfer Partners LP 3,030 % fällig am 02.07.2019 | | 1.300 | 1.141 | 0,08 |
| Essity (0,243) % fällig am 09.10.2019 | € | 5.000 | 5.006 | 0,37 |
| (0,233) % fällig am 15.10.2019 | | 5.000 | 5.006 | 0,37 |
| Fidelity National Information Services, Inc. (0,177) % fällig am 06.09.2019 | | 10.000 | 10.008 | 0,74 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 3,220 % fällig am 05.07.2019 | $ | 4.500 | 3.949 | 0,29 |
| Heineken NV (0,295) % fällig am 05.08.2019 | € | 10.000 | 10.005 | 0,74 |
| HSBC Bank Kanada 1,827 % fällig am 24.07.2019 | CAD | 900 | 604 | 0,05 |
| 1,828 % fällig am 25.07.2019 | | 400 | 268 | 0,02 |
| Koninklijke Philips N.V. (0,264) % fällig am 04.10.2019 | € | 10.000 | 10.007 | 0,74 |
| National Grid PLC (0,304) % fällig am 20.08.2019 | | 10.000 | 10.006 | 0,74 |
| Reckitt Benckiser Treasury Services PLC (0,253) % fällig am 12.09.2019 | | 8.000 | 8.007 | 0,59 |
| Region Reunion (0,309) % fällig am 26.07.2019 | | 10.000 | 10.003 | 0,74 |
| Royal Bank of Kanada 1,765 % fällig am 02.07.2019 | CAD | 1.300 | 873 | 0,06 |
| 1,773 % fällig am 22.07.2019 | | 600 | 403 | 0,03 |
| 1,777 % fällig am 25.07.2019 | | 500 | 336 | 0,03 |
| 1,777 % fällig am 26.07.2019 | | 1.600 | 1.074 | 0,08 |
| Royal Caribbean Cruise 2,900 % fällig am 11.07.2019 | $ | 500 | 439 | 0,03 |
| 2,900 % fällig am 15.07.2019 | | 250 | 219 | 0,02 |
| 2,970 % fällig am 01.07.2019 | | 300 | 263 | 0,02 |
| Toronto-Dominion Bank 1,765 % fällig am 02.07.2019 | CAD | 2.100 | 1.411 | 0,10 |
| 1,787 % fällig am 22.07.2019 | | 900 | 604 | 0,04 |
| 1,788 % fällig am 24.07.2019 | | 1.000 | 671 | 0,05 |
| 1,792 % fällig am 16.07.2019 | | 200 | 134 | 0,01 |
| 1,792 % fällig am 26.07.2019 | | 200 | 134 | 0,01 |
| 1,795 % fällig am 19.07.2019 | | 800 | 537 | 0,04 |
| VW Credit, Inc. 2,900 % fällig am 10.07.2019 | $ | 4.000 | 3.510 | 0,26 |
| WGL Holdings, Inc. 2,850 % fällig am 02.07.2019 | | 7.000 | 6.145 | 0,46 |
| Würth Finance International B.V. (0,238) % fällig am 29.07.2019 | € | 4.200 | 4.202 | 0,31 |
| Xylem, Inc. (0,264) % fällig am 21.08.2019 | | 10.000 | 10.006 | 0,74 |
| | | | 159.393 | 11,81 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (h)** | | | | |
| | | | 67.412 | 5,00 |
| **GREECE TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,466 % fällig am 01.11.2019 (c)(d) | | 12.000 | 11.989 | 0,89 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,198) % fällig am 22.07.2019 (c) | ¥ | 1.810.000 | 14.753 | 1,09 |
| (0,185) % fällig am 22.07.2019 (c) | | 1.100.000 | 8.966 | 0,67 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| (0,155) % fällig am 29.07.2019 (c) | ¥ 1.440.000 | € 11.738 | 0,87 |
| (0,149) % fällig am 29.07.2019 (c) | 1.100.000 | 8.966 | 0,66 |
| (0,144) % fällig am 16.07.2019 (c) | 3.240.000 | 26.409 | 1,96 |
| (0,143) % fällig am 09.09.2019 (c) | 3.200.000 | 26.087 | 1,93 |
| (0,134) % fällig am 17.09.2019 (c) | 3.100.000 | 25.273 | 1,87 |
| | | 122.192 | 9,05 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 360.986 | 26,75 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **€ 1.317.453** | **97,62** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| E-mini NASDAQ 100 Index September Futures | Short | 09/2019 | 220 | € (338) | (0,03) |
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Long | 09/2019 | 192 | 357 | 0,03 |
| Euro STOXX 50 September Futures | Short | 09/2019 | 1.895 | (1.643) | (0,12) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 180 | (320) | (0,03) |
| Hang Seng China Enterprises Index July Futures | Long | 07/2019 | 154 | (12) | 0,00 |
| Nikkei 225 Index September Futures | Long | 09/2019 | 292 | 249 | 0,02 |
| Swiss Market Index September Futures | Short | 09/2019 | 80 | (36) | 0,00 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1.210 | 2.083 | 0,15 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 654 | 1.996 | 0,15 |
| | | | | € 2.336 | 0,17 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 129,000 | 26.07.2019 | 159 | € (34) | € (37) | 0,00 |

**OPTIONEN AUF INDIZES**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT S&P 500 | € 87,500 | 19.07.2019 | 2.316 | € (120) | € (182) | (0,01) |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.650,000 | 18.10.2019 | 90 | (314) | (211) | (0,02) |
| Call - CBOT S&P 500 | 3.050,000 | 18.10.2019 | 90 | (375) | (293) | (0,02) |
| | | | | € (809) | € (686) | (0,05) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **€ 1.613** | **0,12** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Daimler AG | 1,000 % | 20.12.2020 | € 1.100 | € (1) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Crossover 31 5-Year Index | (5,000) % | 20.06.2024 | € 24.900 | € (252) | (0,02) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-32 5-Year Index | 5,000 % | 20.06.2024 | $ 43.500 | € 180 | 0,01 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,500 % | 19.06.2029 | CAD 73.400 | € 655 | 0,05 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | € 58.600 | 2.130 | 0,16 |
| | | | | | € 2.785 | 0,21 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ 2.712** | **0,20** |

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

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

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

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

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | China Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 17.130 | € (303) | € (95) | € (398) | (0,03) |
| BRC | China Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 16.800 | (309) | (82) | (391) | (0,03) |
| | | | | | € (612) | € (177) | € (789) | (0,06) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| HUS | Brasilien Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | $ 2.900 | € 4 | € 0 | € 4 | 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 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.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07/2019 | ¥ | 3.474.469 | € | 28.425 | € 107 | € 0 | € 107 | 0,01 |
| BOA | 07/2019 | CAD | 3.400 | | 2.268 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 112 | £ | 100 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.369 | $ | 2.679 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 4.755.994 | € | 38.919 | 156 | 0 | 156 | 0,01 |
| | 07/2019 | $ | 7.000 | | 6.224 | 78 | 0 | 78 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.951 | RUB | 127.020 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 6.645 | KRW | 7.791.927 | 88 | 0 | 88 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | € | 2.711 | £ | 2.399 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 35.487 | $ | 39.880 | 0 | (468) | (468) | (0,04) |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | £ | 1.895 | € | 2.117 | € 0 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 23.335 | | 20.633 | 142 | 0 | 142 | 0,01 |
| | 08/2019 | € | 2.117 | £ | 1.897 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 9.199.876 | $ | 7.760 | 0 | (179) | (179) | (0,01) |
| BRC | 07/2019 | € | 994 | CAD | 1.505 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 2.540.000 | € | 20.189 | 0 | (510) | (510) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 6.629 | COP | 22.028.167 | 209 | 0 | 209 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 400.757 | € | 358.335 | 6.423 | 0 | 6.423 | 0,47 |
| | 07/2019 | | 6.544 | ZAR | 96.058 | 230 | 0 | 230 | 0,02 |
| | 09/2019 | ¥ | 3.200.000 | € | 26.123 | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | € | 317.248 | $ | 360.553 | 0 | (640) | (640) | (0,05) |
| | 07/2019 | £ | 2.055 | € | 2.329 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 3.240.000 | | 25.822 | 0 | (583) | (583) | (0,04) |
| | 08/2019 | $ | 361.473 | | 317.248 | 642 | 0 | 642 | 0,05 |
| | 08/2019 | | 13.137 | RUB | 863.525 | 408 | 0 | 408 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 18.154 | INR | 1.277.315 | 146 | 0 | 146 | 0,01 |
| | 04/2020 | DKK | 73.165 | € | 9.820 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 31.272 | $ | 35.582 | 19 | (46) | (27) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 1.810.000 | € | 14.294 | 0 | (457) | (457) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ | 6.099 | BRL | 23.496 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 200 | € | 133 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 23.706 | AUD | 38.597 | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 930 | CAD | 1.405 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 175 | $ | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 325 | € | 362 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 375 | CAD | 500 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 12 | € | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 12.870 | RUB | 853.928 | 564 | 0 | 564 | 0,04 |
| | 08/2019 | AUD | 38.655 | € | 23.706 | 0 | (80) | (80) | (0,01) |
| | 09/2019 | HKD | 213.617 | $ | 27.292 | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 1.248 | CNY | 8.651 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 52.248 | $ | 1.669 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| IND | 07/2019 | $ | 3.812 | COP | 12.109.428 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | CAD | 4.000 | € | 2.657 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 939 | ¥ | 115.300 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 525.500 | € | 4.297 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.620 | BRL | 6.228 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.155 | € | 2.794 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 3.812 | INR | 267.103 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 230 | MXN | 4.508 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 16.786 | $ | 535 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | $ | 6.612 | BRL | 25.766 | 97 | 0 | 97 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | CAD | 7.900 | € | 5.287 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 187 | | 209 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 07/2019 | COP | 34.137.595 | $ | 10.738 | 85 | 0 | 85 | 0,01 |
| | 09/2019 | $ | 10.691 | COP | 34.137.595 | 0 | (88) | (88) | (0,01) |
| RYL | 07/2019 | AUD | 2.522 | € | 1.541 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07/2019 | BRL | 91.716 | $ | 23.994 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 18.600 | € | 12.390 | 0 | (94) | (94) | (0,01) |
| | 07/2019 | DKK | 1.765 | | 236 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 531 | $ | 600 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.362 | € | 5.596 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 23.922 | BRL | 91.716 | 0 | (51) | (51) | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 175.475 | € | 23.555 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 04/2020 | € | 237 | DKK | 1.765 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | AUD | 35.807 | € | 22.164 | 99 | 0 | 99 | 0,01 |
| | 07/2019 | DKK | 29.026 | | 3.890 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 104.552 | ¥ | 12.810.048 | 0 | (145) | (145) | (0,01) |
| | 07/2019 | | 6.058 | $ | 6.798 | 0 | (88) | (88) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 5.128.037 | € | 42.066 | 271 | 0 | 271 | 0,02 |
| | 07/2019 | $ | 14.816 | BRL | 59.721 | 672 | 0 | 672 | 0,05 |
| | 08/2019 | ¥ | 12.810.048 | € | 104.533 | 142 | 0 | 142 | 0,01 |
| | 09/2019 | HKD | 168.149 | $ | 21.477 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 20.945 | | 669 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € | 442 | | 500 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 1.100.000 | € | 8.724 | 0 | (241) | (241) | (0,02) |
| | 09/2019 | | 3.100.000 | | 25.467 | 211 | 0 | 211 | 0,01 |
| UAG | 07/2019 | CHF | 3.885 | | 3.456 | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 4.125 | DKK | 30.791 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.623 | £ | 1.434 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 30.791 | € | 4.127 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | € 11.226 | € (4.042) | € 7.184 | 0,53 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | CHF | 497 | € | 447 | € 0 | € (1) | € (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 435 | CHF | 487 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 447 | | 497 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 11 | € | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | € | 445 | CHF | 498 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | CHF | 515 | € | 463 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 445 | CHF | 498 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 447 | | 497 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | CHF | 11 | € | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | € 11 | € (1) | € 10 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | € | 9.782 | £ | 8.738 | € 0 | € (17) | € (17) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 19.196 | | 17.111 | 0 | (73) | (73) | (0,01) |
| CBK | 07/2019 | | 11.433 | | 10.092 | 0 | (154) | (154) | (0,01) |
| GLM | 07/2019 | | 39.281 | | 35.029 | 0 | (133) | (133) | (0,01) |
| HUS | 07/2019 | | 39.704 | | 35.406 | 0 | (134) | (134) | (0,01) |
| RYL | 07/2019 | | 9.045 | | 8.000 | 0 | (105) | (105) | (0,01) |
| SOG | 07/2019 | £ | 42.440 | € | 47.398 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 47.398 | £ | 42.483 | 32 | 0 | 32 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | | 1.194 | | 1.067 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 31 | € | 35 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | € | 10.392 | £ | 9.180 | 0 | (133) | (133) | (0,01) |
| | | | | | | € 32 | € (781) | € (749) | (0,05) |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional USD (Hedged) thesaurierend und Class E USD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 473 | $ | 531 | € 0 | € (7) | € (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 18.193 | € | 16.009 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 16.009 | $ | 18.239 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | $ | 16.550 | € | 14.556 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 14.556 | $ | 16.592 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 16.030 | | 17.901 | 0 | (310) | (310) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 19.110 | € | 16.813 | 33 | (1) | 32 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 16.009 | $ | 18.241 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 16.040 | | 17.901 | 0 | (322) | (322) | (0,03) |
| JPM | 07/2019 | | 33 | | 38 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 16.420 | | 18.338 | 0 | (317) | (317) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 1.352 | € | 1.195 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 477 | | 423 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | | | | | | € 103 | € (1.046) | € (943) | (0,07) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **€ 4.717** | **0,35** |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Katar National Bank** (0,001) % fällig am 11.10.2019 | € 8.000 | 8.010 | 0,59 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **€ 8.010** | **0,59** |
| **Summe Anlagen** | | **€ 1.334.505** | **98,88** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **€ 15.089** | **1,12** |
| **Nettovermögen** | | **€ 1.349.594** | **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) 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.**

**Barmittel in Höhe von EUR 6.162 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Aktienoptionsgeschäfte regeln, verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von EUR 16.902 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von EUR 2.900 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | € 5.138 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | € (4.604) | € 4.512 | € 4.513 | 0,33 |
| IND | (0,460) | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 62.900 | ABN AMRO Bank NV 3,500 % fällig am 21.09.2022 | (51.306) | 62.900 | 62.898 | 4,67 |
| | | | | | Santander UK PLC 1,625 % fällig am 26.11.2020 | (10.770) | | | |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (66.680)** | **€ 67.412** | **€ 67.411** | **5,00** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 305.505 | € 1.011.948 | € 0 | € 1.317.453 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 8.010 | 0 | 8.010 |
| Finanzderivate[3] | 2.299 | 6.743 | 0 | 9.042 |
| **Summen** | **€ 307.804** | **€ 1.026.701** | **€ 0** | **€ 1.334.505** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 218.110 | € 923.946 | € 177 | € 1.142.233 |
| Finanzderivate[3] | (614) | (124) | 0 | (738) |
| **Summen** | **€ 217.496** | **€ 923.822** | **€ 177** | **€ 1.141.495** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | € 107 | € 0 | € 107 |
| BOA | 320 | (260) | 60 |
| BPS | (1.006) | 1.050 | 44 |
| BRC | 6.032 | (5.395) | 637 |
| CBK | (459) | 540 | 81 |
| DUB | 0 | (10) | (10) |
| GLM | (926) | 820 | (106) |
| HUS | 382 | (360) | 22 |
| IND | (33) | 0 | (33) |
| JPM | 25 | 10 | 35 |
| MSB | 97 | 0 | 97 |
| MYI | (13) | 0 | (13) |
| RBC | (3) | 0 | (3) |
| RYL | (171) | (190) | (361) |
| SCX | 899 | (980) | (81) |
| SOG | 1 | 0 | 1 |
| SSB | (343) | 480 | 137 |
| UAG | (192) | 0 | (192) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 64,79 | 65,17 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 27,40 | 18,16 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 5,43 | 12,82 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,12 | (0,06) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,20 | 0,13 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,35 | (0,13) |
| Einlagenzertifikate | 0,59 | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 28,04 | 34,83 |
| US-Schatzobligationen | 0,00 | 4,15 |
| Non-Agency-MBS | 2,62 | 2,58 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 8,91 | 6,47 |
| Staatsemissionen | 3,04 | 6,59 |
| Investmentfonds | 5,97 | 9,61 |
| Stammaktien | 18,58 | 12,27 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 3,71 | 0,00 |
| Kurzfristige Instrumente | 26,75 | 19,65 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,17 | (0,05) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf Indizes | (0,05) | (0,01) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,02) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,21 | 0,13 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf Indizes | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | (0,06) | 0,00 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,00 | (0,03) |
| Devisenterminkontrakte | 0,53 | (0,08) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | (0,12) | (0,01) |
| Einlagenzertifikate | 0,59 | 0,00 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 1,12 | 3,91 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Asia Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Optus Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.06.2029 | € | 300 | $ 347 | 0,97 |
| **Santos Finance Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 13.03.2029 | $ | 200 | 209 | 0,59 |
| Summe Australien | | | 556 | 1,56 |
| **BAHAMAS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Competition Team Technologies Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 12.03.2029 | | 200 | 208 | 0,59 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Harvest Operations Corp.** | | | | |
| 2,330 % fällig am 14.04.2021 | | 540 | 537 | 1,51 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.02.2023 | HKD | 2.000 | 240 | 0,67 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **21Vianet Group, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2021 | $ | 400 | 413 | 1,16 |
| **Central China Real Estate Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 24.04.2023 | | 200 | 198 | 0,56 |
| **Champion MTN Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 17.01.2023 | | 200 | 205 | 0,58 |
| **China Aoyuan Group Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 23.01.2022 | | 200 | 211 | 0,59 |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 6,250 % fällig am 28.06.2021 | | 200 | 192 | 0,54 |
| 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 400 | 387 | 1,09 |
| **China Mengniu Dairy Co. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.08.2023 | | 200 | 209 | 0,59 |
| **CIFI Holdings Group Co. Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 23.01.2022 (f) | | 200 | 199 | 0,56 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 25.04.2022 | | 200 | 212 | 0,60 |
| **Future Land Development Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,150 % fällig am 15.04.2023 | | 200 | 198 | 0,56 |
| **Geely Automobile Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 25.01.2023 | | 200 | 201 | 0,56 |
| **Goodman HK Finance** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.06.2024 | | 300 | 315 | 0,88 |
| **Health and Happiness International Holdings Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 21.06.2021 | | 308 | 315 | 0,88 |
| **Hutchison Whampoa International Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 31.10.2024 | | 200 | 209 | 0,59 |
| **Kaisa Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 30.06.2022 | | 205 | 196 | 0,55 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2024 | | 300 | 308 | 0,86 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.02.2022 | | 500 | 510 | 1,43 |
| **Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 23.01.2023 | | 200 | 201 | 0,56 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,925 % fällig am 19.01.2038 | | 200 | 202 | 0,57 |
| **Times China Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,600 % fällig am 02.03.2023 | | 200 | 199 | 0,56 |
| **VLL International, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 28.11.2024 | | 200 | 202 | 0,57 |
| **WTT Investment Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 21.11.2022 | | 200 | 207 | 0,58 |
| **Yingde Gases Investment Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 19.01.2023 | | 200 | 204 | 0,57 |
| | | | 5.693 | 15,99 |
| Summe Cayman Inseln | | | 5.933 | 16,66 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of China Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 13.11.2024 (e) | $ | 200 | $ 215 | 0,60 |
| **Bank of Communications Co. Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 03.10.2024 (e) | | 200 | 201 | 0,57 |
| **CCCI Treasure Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 21.04.2020 (c) | | 300 | 300 | 0,84 |
| **CGNPC International Ltd.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 11.12.2024 | € | 300 | 354 | 1,00 |
| **China Construction Bank Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 13.05.2025 (e) | $ | 200 | 201 | 0,57 |
| **China Life Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 03.07.2135 | | 200 | 200 | 0,56 |
| **CRCC Yupeng Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.08.2019 (c) | | 400 | 400 | 1,12 |
| **Dongfeng Motor Hong Kong International Co. Ltd.** | | | | |
| 1,150 % fällig am 23.10.2021 | € | 400 | 465 | 1,31 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 10.12.2019 (c)(e) | $ | 200 | 202 | 0,57 |
| **Overseas Chinese Town Asia Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 10.10.2020 (c) | | 200 | 200 | 0,56 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 28.04.2025 | | 600 | 613 | 1,72 |
| 3,900 % fällig am 17.05.2022 | | 200 | 207 | 0,58 |
| **Yankuang Group Cayman Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.11.2020 | | 400 | 399 | 1,12 |
| **Zoomlion HK SPV Co. Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 20.12.2022 | | 400 | 400 | 1,12 |
| Summe China | | | 4.357 | 12,24 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bright Food Singapur Holdings Pte Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 09.08.2022 (b) | | 250 | 254 | 0,71 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Shanghai Port Group BVI Holding Co. Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 19.06.2024 | € | 300 | 346 | 0,97 |
| **China Shenhua Overseas Capital Co. Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 20.01.2025 | $ | 200 | 208 | 0,58 |
| **CMHI Finance BVI Co. Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 06.08.2028 | | 200 | 223 | 0,63 |
| **CNOOC Finance Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 09.05.2023 | | 200 | 202 | 0,57 |
| **CNOOC Finance USA LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 02.05.2028 | | 400 | 435 | 1,22 |
| **Far East Horizon Ltd.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 14.06.2022 (c) | | 400 | 386 | 1,08 |
| **Franshion Brilliant Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 17.01.2022 (c) | | 200 | 191 | 0,54 |
| **GLP China Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,974 % fällig am 26.02.2024 | | 200 | 210 | 0,59 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.05.2022 | | 400 | 405 | 1,14 |
| **Huaneng Hong Kong Capital Ltd.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 30.10.2022 (c) | | 200 | 196 | 0,55 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 07.11.2022 (c) | | 300 | 294 | 0,83 |
| 5,500 % fällig am 16.01.2025 | | 600 | 655 | 1,84 |
| **ICBCIL Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 19.05.2021 | | 200 | 200 | 0,56 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Asia Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 21.07.2021 (c)(e) | | 200 | 199 | 0,56 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 4,071 % fällig am 25.05.2023 | | 200 | 200 | 0,56 |
| | | | 4.350 | 12,22 |
| Summe Hongkong | | | 4.604 | 12,93 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 03.07.2029 (a) | | 200 | 203 | 0,57 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Bharti Airtel International Niederlande BV** | | | | |
| 5,350 % fällig am 20.05.2024 | $ | 200 | $ 212 | 0,60 |
| **Delhi International Airport Ltd.** | | | | |
| 6,450 % fällig am 04.06.2029 | | 200 | 211 | 0,59 |
| **GMR Hyderabad International Airport Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 10.04.2024 | | 300 | 305 | 0,86 |
| **Oil Indien International Pte Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.04.2027 | | 200 | 203 | 0,57 |
| **Power Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 06.12.2027 | | 200 | 196 | 0,55 |
| **ReNew Power Synthetic** | | | | |
| 6,670 % fällig am 12.03.2024 | | 400 | 409 | 1,15 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,700 % fällig am 27.02.2022 | | 400 | 406 | 1,14 |
| **State Bank of Indien** | | | | |
| 4,500 % fällig am 28.09.2023 | | 200 | 211 | 0,59 |
| | | | 2.356 | 6,62 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of Indien** | | | | |
| 3,875 % fällig am 12.03.2024 | | 400 | 413 | 1,16 |
| Summe Indien | | | 2.769 | 7,78 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank Mandiri Persero Tbk PT** | | | | |
| 3,750 % fällig am 11.04.2024 | | 400 | 408 | 1,15 |
| **Bank Rakyat Indonesien Persero Tbk PT** | | | | |
| 3,950 % fällig am 28.03.2024 | | 400 | 411 | 1,15 |
| **Indonesien Asahan Aluminium Persero PT** | | | | |
| 6,757 % fällig am 15.11.2048 | | 200 | 246 | 0,69 |
| **LLPL Capital Pte Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 04.02.2039 | | 400 | 458 | 1,29 |
| **Pelabuhan Indonesien PT** | | | | |
| 5,375 % fällig am 05.05.2045 | | 200 | 210 | 0,59 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 6,000 % fällig am 03.05.2042 | | 200 | 230 | 0,65 |
| **Perusahaan Listrik Negara PT** | | | | |
| 5,375 % fällig am 25.01.2029 | | 300 | 332 | 0,93 |
| **TBG Global Pte. Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 10.02.2022 | | 200 | 204 | 0,57 |
| | | | 2.499 | 7,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesien Government International Bond** | | | | |
| 1,450 % fällig am 18.09.2026 | € | 300 | 350 | 0,98 |
| 4,450 % fällig am 11.02.2024 | $ | 850 | 904 | 2,54 |
| 8,750 % fällig am 15.02.2044 | IDR | 2.300.000 | 171 | 0,48 |
| | | | 1.425 | 4,00 |
| Summe Indonesien | | | 3.924 | 11,02 |

| | | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|---|
| **IRLAND** | | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (d)** | | 10.100 | 1.025 | 2,88 |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Specialty Funds Irland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)** | | 1.880 | 22 | 0,06 |
| Summe Irland | | | 1.047 | 2,94 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Asahi Mutual Life Insurance Co.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 05.09.2023 (c) | $ | 200 | 209 | 0,59 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **West China Cement Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 11.09.2019 | $ | 100 | $ 101 | 0,28 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 400 | 433 | 1,22 |
| **Dream Global Funding SARL** | | | | |
| 1,750 % fällig am 28.06.2026 | € | 200 | 230 | 0,64 |
| Summe Luxemburg | | | 663 | 1,86 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **TNB Global Ventures Capital Bhd.** | | | | |
| 3,244 % fällig am 19.10.2026 | $ | 200 | 198 | 0,56 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Malaysia Government International Bond** | | | | |
| 4,921 % fällig am 06.07.2048 | MYR | 1.700 | 452 | 1,27 |
| Summe Malaysia | | | 650 | 1,83 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Greenko Investment Co.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 16.08.2023 | $ | 250 | 244 | 0,68 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Trust F** | | | | |
| 4,869 % fällig am 15.01.2030 | | 200 | 202 | 0,57 |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 200 | 205 | 0,57 |
| Summe Mexiko | | | 407 | 1,14 |
| **MONGOLEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mongolei Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 05.12.2022 | | 200 | 202 | 0,57 |
| 5,625 % fällig am 01.05.2023 | | 200 | 204 | 0,57 |
| Summe Mongolei | | | 406 | 1,14 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 200 | 208 | 0,59 |
| **PAKISTAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Pakistan Government International Bond** | | | | |
| 6,875 % fällig am 05.12.2027 | | 200 | 203 | 0,57 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **SM Investments Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 10.06.2024 | | 200 | 208 | 0,58 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Philippinen Government International Bond** | | | | |
| 6,250 % fällig am 14.01.2036 | PHP | 10.000 | $ 224 | 0,63 |
| 7,750 % fällig am 14.01.2031 | $ | 400 | 591 | 1,66 |
| 9,500 % fällig am 02.02.2030 | | 200 | 320 | 0,90 |
| | | | 1.135 | 3,19 |
| Total Philippinen | | | 1.343 | 3,77 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABJA Investment Co. Pte. Ltd.** | | | | |
| 5,450 % fällig am 24.01.2028 | | 200 | 192 | 0,54 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 27.04.2026 | | 200 | 205 | 0,57 |
| **United Overseas Bank Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 16.09.2026 (e) | | 200 | 202 | 0,57 |
| Summe Singapur | | | 599 | 1,68 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **KEB Hana Bank** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.10.2024 (e) | | 200 | 212 | 0,60 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2029 (e) | | 400 | 431 | 1,21 |
| **Korean Reinsurance Co.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 21.10.2044 | | 200 | 200 | 0,56 |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 23.04.2029 (e) | | 400 | 415 | 1,17 |
| **SK Broadband Co. Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 13.08.2023 | | 200 | 208 | 0,58 |
| Summe Südkorea | | | 1.466 | 4,12 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **National Savings Bank** | | | | |
| 5,150 % fällig am 10.09.2019 | | 200 | 200 | 0,56 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 6,125 % fällig am 03.06.2025 | | 400 | 391 | 1,10 |
| Summe Sri Lanka | | | 591 | 1,66 |
| **THAILAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bangkok Bank PCL** | | | | |
| 4,450 % fällig am 19.09.2028 | | 200 | 218 | 0,61 |
| **Krung Thai Bank PCL** | | | | |
| 5,200 % fällig am 26.12.2024 (e) | | 300 | 303 | 0,85 |
| **Thaioil Treasury Center Co. Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 20.11.2048 | | 200 | 242 | 0,68 |
| Summe Thailand | | | 763 | 2,14 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (c)(e) | € | 250 | 288 | 0,81 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (c)(e) | $ | 300 | $ 308 | 0,86 |
| **Vedanta Resources Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 09.08.2024 | | 200 | 185 | 0,52 |
| Summe Großbritannien | | | 781 | 2,19 |
| **USA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.09.2026 | | 200 | 189 | 0,53 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Celestial Dynasty Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 27.06.2029 | | 400 | 404 | 1,14 |
| **Celestial Miles Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.01.2024 (c) | | 200 | 210 | 0,59 |
| **China Reinsurance Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 09.03.2022 | | 200 | 200 | 0,56 |
| **Easy Tactic Ltd.** | | | | |
| 8,625 % fällig am 27.02.2024 | | 400 | 407 | 1,14 |
| **King Power Capital Ltd.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 03.11.2024 | | 200 | 225 | 0,63 |
| **RKPF Overseas 2019 B Ltd.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 18.04.2021 | | 400 | 418 | 1,17 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 11.02.2024 | | 200 | 209 | 0,59 |
| **Wiseyear Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 06.04.2021 | | 200 | 210 | 0,59 |
| Summe Jungferninseln (Britisch) | | | 2.283 | 6,41 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (g)** | | | 859 | 2,41 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 859 | 2,41 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | | 22.841 | 229 | 0,64 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 36.129** | **101,46** |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 2 | $ (4) | (0,01) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 172,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 2 | (1) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 174,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 1 | 0 | 0,00 |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09/2019 | 5 | (2) | (0,01) |

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 2 | $ (5) | (0,01) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 168,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 2 | 1 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 2 | 1 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 1 | 0 | 0,00 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 7 | 10 | 0,03 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 22 | 39 | 0,11 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 3 | 2 | 0,01 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 2 | 8 | 0,02 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 1 | 9 | 0,03 |
| | | | | $ 58 | 0,17 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 58** | **0,17** |

[1] Future-Style-Option.

## 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[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | South Korea Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 5.800 | $ (182) | $ 2 | $ (180) | (0,50) |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Tencent Holdings Ltd. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 250 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| BRC | Philippinen Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 200 | 2 | 2 | 4 | 0,01 |
| CBK | Alibaba Group Holding Ltd. | 1,000 | 20.06.2024 | 250 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | Sinopec Group Overseas Development Ltd. | 1,000 | 20.06.2024 | 250 | 4 | (1) | 3 | 0,01 |
| | | | | | $ 11 | $ 1 | $ 12 | 0,03 |

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

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

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

### ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SCX | Zahlung | 3-Month CNY-CNREPOFIX | 3,246 % | 19.06.2024 | CNY 4.900 | $ 0 | $ 11 | $ 11 | 0,03 |

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 303 | $ | 340 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 353 | ¥ | 38.400 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | € | 322 | $ | 361 | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 355 | ¥ | 38.564 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | € | 964 | $ | 1.078 | 0 | (21) | (21) | (0,06) |
| | 09/2019 | MYR | 1.879 | | 453 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | € | 190 | | 216 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.142 | € | 1.885 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 08/2019 | € | 1.885 | $ | 2.147 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 329 | £ | 259 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 40 | $ | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 09/2019 | KRW | 415.514 | | 351 | 0 | (9) | (9) | (0,02) |
| | 09/2019 | $ | 353 | KRW | 409.088 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | TWD | 10.531 | $ | 345 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 11/2019 | TWD | 8.328 | $ | 266 | $ 0 | $ (4) | $ (4) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | € | 299 | | 335 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 08/2019 | £ | 257 | | 336 | 9 | 0 | 9 | 0,02 |
| | 11/2019 | TWD | 2.675 | | 85 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | $ | 335 | TWD | 10.531 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| | 11/2019 | TWD | 10.531 | $ | 336 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| SSB | 09/2019 | HKD | 2.098 | | 268 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | ¥ | 38.564 | | 358 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 359 | ¥ | 38.564 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 91 | $ | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 33 | $ (64) | $ (31) | (0,09) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ (188)** | **(0,53)** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | | | **$ 35.999** | **101,10** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | | | **$ (391)** | **(1,10)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | | | **$ 35.608** | **100,00** |

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

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

**(a) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(b) Nullkuponwertpapier.**

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

**(d) Mit dem Fonds verbunden.**

**(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**Barmittel in Höhe von USD 67 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**(f) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kaufdatum | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| CIFI Holdings Group Co. Ltd. | 5,500 % | 23.01.2022 | 16.04.2019 | $ 196 | $ 199 | 0,56 |

**(g) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 1,350 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 859 | U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021 | $ (880) | $ 859 | $ 859 | 2,41 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (880)** | **$ 859** | **$ 859** | **2,41** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.276 | $ 34.853 | $ 0 | $ 36.129 |
| Finanzderivate[3] | 58 | (188) | 0 | (130) |
| **Summen** | **$ 1.334** | **$ 34.665** | **$ 0** | **$ 35.999** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.196 | $ 31.950 | $ 0 | $ 33.146 |
| Finanzderivate[3] | 40 | (66) | 0 | (26) |
| **Summen** | **$ 1.236** | **$ 31.884** | **$ 0** | **$ 33.120** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (1) | $ 0 | $ (1) |
| BRC | (198) | 0 | (198) |
| CBK | 7 | 0 | 7 |
| GLM | (8) | 0 | (8) |
| JPM | 1 | 0 | 1 |
| SCX | 11 | 0 | 11 |
| SSB | (1) | 0 | (1) |
| UAG | 1 | 0 | 1 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 101,46 | 93,73 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 0,00 | 3,73 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,00 | 1,28 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,17 | 0,12 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,00 | (0,06) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,53) | (0,14) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 1,56 | 0,00 |
| Bahamas | 0,59 | 0,00 |
| Bermuda | 0,00 | 0,81 |
| Kanada | 1,51 | 1,56 |
| Cayman-Inseln | 16,66 | 16,79 |
| China | 12,24 | 20,93 |
| Hongkong | 12,93 | 14,59 |
| Indien | 7,78 | 4,52 |
| Indonesien | 11,02 | 7,87 |
| Irland | 2,94 | 3,10 |
| Japan | 0,59 | 0,00 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,28 | 0,48 |
| Luxemburg | 1,86 | 0,00 |
| Malaysia | 1,83 | 0,56 |
| Mauritius | 0,68 | 0,70 |
| Mexiko | 1,14 | 0,00 |
| Mongolei | 1,14 | 0,56 |
| Niederlande | 0,59 | 0,56 |
| Pakistan | 0,57 | 0,54 |
| Philippinen | 3,77 | 3,94 |
| Singapur | 1,68 | 3,95 |
| Südkorea | 4,12 | 2,67 |
| Sri Lanka | 1,66 | 1,16 |
| Thailand | 2,14 | 2,71 |
| Großbritannien | 2,19 | 3,21 |
| Vereinigte Staaten | 0,53 | 0,52 |
| Jungferninseln (Britisch) | 6,41 | 5,27 |
| Kurzfristige Instrumente | 2,41 | 1,28 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,64 | 0,46 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,17 | 0,12 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Zinsswaps | 0,00 | (0,06) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | (0,50) | (0,06) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,03 | (0,07) |
| Zinsswaps | 0,03 | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | (0,09) | (0,01) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (1,10) | 1,34 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco de Galicia y Buenos Aires S.A.** | | | | | |
| 25,980 % fällig am 26.04.2020 | ARS | 39.000 | $ | 652 | 0,03 |
| **HSBC Bank Argentinien S.A.** | | | | | |
| 25,250 % fällig am 27.09.2019 | | 82.300 | | 1.765 | 0,07 |
| | | | | 2.417 | 0,10 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Argentinien Government International Bond** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.03.2020 | | 97.199 | | 1.904 | 0,08 |
| 40,244 % fällig am 04.10.2022 | | 28.170 | | 986 | 0,04 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a)(j) | | 324.023 | | 6.584 | 0,26 |
| 53,892 % fällig am 01.03.2020 (a) | | 1.200 | | 27 | 0,00 |
| **Argentinien Treasury Bond** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 28.04.2020 | | 510.338 | | 9.361 | 0,38 |
| **Autonomous City of Buenos Aires Argentinien** | | | | | |
| 52,674 % fällig am 29.03.2024 (a) | | 281.489 | | 5.438 | 0,22 |
| 54,688 % fällig am 22.02.2028 (a) | | 183.030 | | 3.524 | 0,14 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | | |
| 54,431 % fällig am 06.12.2019 (a) | | 11.990 | | 273 | 0,01 |
| 54,501 % fällig am 12.04.2025 (a) | | 292.763 | | 5.477 | 0,22 |
| 54,515 % fällig am 31.05.2022 (a) | | 191.683 | | 3.734 | 0,15 |
| | | | | 37.308 | 1,50 |
| Summe Argentinien | | | | 39.725 | 1,60 |
| **BRASILIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Brasilien Minas SPE via State of Minas Gerais** | | | | | |
| 5,333 % fällig am 15.02.2028 | $ | 270 | | 279 | 0,01 |
| **Centrais Eletricas Brasileiras S.A.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 30.07.2019 | | 3.300 | | 3.309 | 0,13 |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.07.2019 (e)(g) | | 485 | | 5 | 0,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 2.443 | | 2.623 | 0,11 |
| 8,375 % fällig am 23.05.2021 | | 467 | | 516 | 0,02 |
| **Swiss Insured Brasilien Power Finance SARL** | | | | | |
| 9,850 % fällig am 16.07.2032 | BRL | 202.846 | | 57.954 | 2,34 |
| Summe Brasilien | | | | 64.686 | 2,61 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | | |
| **FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.** | | | | | |
| 3,512 % fällig am 20.04.2027 | $ | 1.149 | | 1.146 | 0,05 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **China Evergrande Group** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 12.500 | | 12.082 | 0,49 |
| **Fab Sukuk Co. Ltd.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 05.03.2023 | | 1.100 | | 1.130 | 0,04 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | | 174 | | 173 | 0,01 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 (c) | | 445 | | 277 | 0,01 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 | | 429 | | 414 | 0,02 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,576 % fällig am 02.05.2022 | | 12.200 | | 12.292 | 0,50 |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 9.700 | | 9.724 | 0,39 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 7.800 | | 7.819 | 0,31 |
| **SPARC EM SPC Panama Metro Line SP** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.12.2022 (e)(j) | | 7.431 | | 7.060 | 0,28 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 | | 3.700 | | 3.702 | 0,15 |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 | | 1.600 | | 1.643 | 0,07 |
| | | | | 56.316 | 2,27 |
| Summe Cayman Inseln | | | | 57.462 | 2,32 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **CHILE** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.10.2023 | CLP | 139.461 | $ | 242 | 0,01 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.03.2023 (j) | | 10.000.000 | | 15.401 | 0,62 |
| 4,500 % fällig am 01.03.2026 (j) | | 5.555.000 | | 8.878 | 0,36 |
| 4,700 % fällig am 01.09.2030 (j) | | 7.165.000 | | 11.910 | 0,48 |
| 5,000 % fällig am 01.03.2035 (j) | | 3.195.000 | | 5.573 | 0,23 |
| **Bonos del Banco Central de Chile en Pesos** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.03.2022 | | 1.620.000 | | 2.596 | 0,10 |
| Summe Chile | | | | 44.600 | 1,80 |
| **CHINA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **China Government International Bond** | | | | | |
| 3,100 % fällig am 29.06.2022 | CNY | 500 | | 73 | 0,00 |
| **KOLUMBIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco Davivienda S.A.** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 24.10.2022 | COP | 19.100.000 | | 6.173 | 0,25 |
| **Empresas Publicas de Medellin ESP** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 10.09.2024 | | 17.497.000 | | 5.557 | 0,23 |
| 8,375 % fällig am 01.02.2021 | | 13.366.000 | | 4.319 | 0,17 |
| 8,375 % fällig am 08.11.2027 | | 26.047.000 | | 8.496 | 0,34 |
| | | | | 24.545 | 0,99 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Kolumbien Government International Bond** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 14.04.2021 | | 6.298.000 | | 2.055 | 0,08 |
| 9,850 % fällig am 28.06.2027 | | 44.287.000 | | 17.386 | 0,70 |
| **Kolumbienn TES** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 28.04.2028 | | 111.346.700 | | 34.869 | 1,41 |
| 6,250 % fällig am 26.11.2025 | | 8.094.800 | | 2.619 | 0,11 |
| 7,000 % fällig am 30.06.2032 | | 68.938.700 | | 22.789 | 0,92 |
| 7,500 % fällig am 26.08.2026 | | 15.887.200 | | 5.488 | 0,22 |
| 7,750 % fällig am 18.09.2030 | | 183.533.800 | | 64.481 | 2,61 |
| **Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 12.08.2024 | | 20.812.000 | | 7.003 | 0,28 |
| | | | | 156.690 | 6,33 |
| Summe Kolumbien | | | | 181.235 | 7,32 |
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Czech Republic Government International Bond** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 10.02.2020 (e) | CZK | 56.200 | | 2.494 | 0,10 |
| 0,950 % fällig am 15.05.2030 | | 353.440 | | 14.870 | 0,60 |
| 1,000 % fällig am 26.06.2026 | | 158.300 | | 6.879 | 0,28 |
| 2,400 % fällig am 17.09.2025 | | 29.100 | | 1.377 | 0,05 |
| 3,750 % fällig am 12.09.2020 | | 41.500 | | 1.909 | 0,08 |
| 4,200 % fällig am 04.12.2036 | | 33.000 | | 1.982 | 0,08 |
| Summe Tschechische Republik | | | | 29.511 | 1,19 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Dominican Republic International Bond** | | | | | |
| 8,900 % fällig am 15.02.2023 | DOP | 174.150 | $ | 3.461 | 0,14 |
| 9,750 % fällig am 05.06.2026 | | 1.217.000 | | 24.758 | 1,00 |
| Summe Dominikanische Republik | | | | 28.219 | 1,14 |
| **FRANKREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 6,240 % fällig am 06.02.2025 | IDR | 396.200.000 | | 27.356 | 1,11 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 2.600 | | 2.986 | 0,12 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2020 | £ | 5.000 | | 6.361 | 0,26 |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | € | 2.000 | | 2.313 | 0,09 |
| 3,567 % fällig am 13.07.2020 (j) | $ | 6.400 | | 6.360 | 0,26 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 (j) | | 11.500 | | 11.662 | 0,47 |
| 5,000 % fällig am 14.02.2022 (j) | | 2.000 | | 2.062 | 0,08 |
| 6,680 % fällig am 23.01.2025 | IDR | 689.400.000 | | 46.993 | 1,90 |
| Summe Deutschland | | | | 78.737 | 3,18 |
| **HONGKONG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.05.2022 (j) | $ | 3.650 | | 3.691 | 0,15 |
| **UNGARN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ungarn Government International Bond** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.04.2021 | HUF | 544.200 | | 1.923 | 0,08 |
| 1,500 % fällig am 24.08.2022 | | 16.714.200 | | 60.067 | 2,43 |
| 2,500 % fällig am 24.10.2024 | | 4.766.600 | | 17.587 | 0,71 |
| 2,750 % fällig am 22.12.2026 | | 20.059.200 | | 74.101 | 2,99 |
| 3,000 % fällig am 26.06.2024 | | 7.504.300 | | 28.415 | 1,15 |
| 5,500 % fällig am 24.06.2025 | | 166.600 | | 712 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 24.11.2023 | | 4.656.000 | | 19.751 | 0,80 |
| 7,000 % fällig am 24.06.2022 | | 2.012.000 | | 8.390 | 0,34 |
| 7,500 % fällig am 12.11.2020 | | 31.800 | | 123 | 0,00 |
| Summe Ungarn | | | | 211.069 | 8,53 |
| **INDIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **State Bank of Indien** | | | | | |
| 3,442 % fällig am 20.01.2020 | $ | 20.000 | | 20.033 | 0,81 |
| 4,000 % fällig am 24.01.2022 | | 3.100 | | 3.173 | 0,13 |
| Summe Indien | | | | 23.206 | 0,94 |
| **INDONESIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Indonesien Asahan Aluminium Persero PT** | | | | | |
| 5,230 % fällig am 15.11.2021 (j) | | 3.000 | | 3.164 | 0,13 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Jasa Marga Persero Tbk PT** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 11.12.2020 | IDR | 89.620.000 | $ | 6.191 | 0,25 |
| | | | | 9.355 | 0,38 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Indonesien Government International Bond** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.05.2048 | | 65.676.000 | | 4.194 | 0,17 |
| 8,750 % fällig am 15.02.2044 | | 75.994.000 | | 5.664 | 0,23 |
| 9,500 % fällig am 15.05.2041 | | 3.363.000 | | 272 | 0,01 |
| | | | | 10.130 | 0,41 |
| Summe Indonesien | | | | 19.485 | 0,79 |
| **IRLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € | 8.600 | | 9.914 | 0,40 |
| **AerCap Irland Capital DAC** | | | | | |
| 4,450 % fällig am 16.12.2021 (j) | $ | 1.400 | | 1.454 | 0,06 |
| **Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC** | | | | | |
| 9,350 % fällig am 06.08.2022 | RUB | 794.000 | | 12.978 | 0,52 |
| **GE Capital European Funding Unlimited Co.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.05.2021 | € | 300 | | 341 | 0,01 |
| 0,069 % fällig am 21.01.2020 | | 100 | | 114 | 0,01 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 (j) | $ | 1.600 | | 1.593 | 0,06 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 31.07.2019 | £ | 300 | | 383 | 0,02 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 (j) | $ | 1.200 | | 1.216 | 0,05 |
| | | | | 27.993 | 1,13 |
| | | **AKTIEN** | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (h)** | | 113.108 | | 11.479 | 0,46 |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | | |
| **PIMCO Specialty Funds Irland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)** | | 748.248 | | 8.710 | 0,35 |
| Summe Irland | | | | 48.182 | 1,94 |
| | | **PARI (000S)** | | | |
| **JAPAN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Nomura International Funding Pte. Ltd.** | | | | | |
| 6,625 % fällig am 18.05.2033 | IDR | 623.000.000 | | 39.750 | 1,61 |
| **KASACHSTAN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Development Bank of Kasachstan JSC** | | | | | |
| 8,950 % fällig am 04.05.2023 | KZT | 2.290.000 | | 5.820 | 0,24 |
| **LUXEMBURG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(c) | $ | 1.066 | | 511 | 0,02 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | | |
| 5,338 % fällig am 25.09.2020 | £ | 4.100 | $ | 5.465 | 0,22 |
| Summe Luxemburg | | | | 5.976 | 0,24 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **MALAYSIA** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Malaysia Government Investment Issue** | | | |
| 3,795 % fällig am 30.09.2022 MYR | 44.450 | 10.899 | 0,44 |
| 3,882 % fällig am 14.03.2025 | 5.250 | 1.295 | 0,05 |
| 3,892 % fällig am 15.03.2027 | 6.300 | 1.545 | 0,06 |
| 3,955 % fällig am 15.09.2025 | 72.100 | 17.849 | 0,72 |
| 4,059 % fällig am 30.09.2024 | 23.270 | 5.791 | 0,23 |
| 4,181 % fällig am 15.07.2024 | 78.608 | 19.651 | 0,80 |
| 4,254 % fällig am 31.05.2035 | 11.590 | 2.876 | 0,12 |
| 4,392 % fällig am 15.04.2026 | 17.670 | 4.478 | 0,18 |
| 4,709 % fällig am 15.09.2026 | 12.650 | 3.264 | 0,13 |
| 4,736 % fällig am 15.03.2046 | 11.000 | 2.822 | 0,11 |
| 4,837 % fällig am 15.07.2025 (i) | 400 | 103 | 0,01 |
| 4,921 % fällig am 06.07.2048 | 65.506 | 17.399 | 0,70 |
| 4,935 % fällig am 30.09.2043 | 21.030 | 5.552 | 0,23 |
| **Malaysia Government Investment Issue** | | | |
| 3,990 % fällig am 15.10.2025 | 32.185 | 7.971 | 0,32 |
| 4,094 % fällig am 30.11.2023 | 33.880 | 8.404 | 0,34 |
| 4,128 % fällig am 15.08.2025 | 1.000 | 249 | 0,01 |
| 4,444 % fällig am 22.05.2024 | 14.720 | 3.713 | 0,15 |
| 4,467 % fällig am 15.09.2039 | 17.486 | 4.474 | 0,18 |
| 4,724 % fällig am 15.06.2033 | 40.363 | 10.591 | 0,43 |
| Summe Malaysia | | 128.926 | 5,21 |
| **MEXIKO** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. (d)** | 212.074 | 0 | 0,00 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **America Movil S.A.B. de C.V.** | | | |
| 6,450 % fällig am 05.12.2022 | 180.700 | 8.855 | 0,36 |
| 8,460 % fällig am 18.12.2036 | 76.800 | 3.668 | 0,15 |
| **Corp. GEO S.A.B. de C.V.** | | | |
| 8,875 % fällig am 25.09.2014 ^ $ | 250 | 0 | 0,00 |
| 9,250 % fällig am 30.06.2020 ^ | 700 | 0 | 0,00 |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.** | | | |
| 9,620 % fällig am 28.06.2018 ^ MXN | 22.130 | 35 | 0,00 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | |
| 7,190 % fällig am 12.09.2024 | 494.600 | 21.508 | 0,87 |
| **Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.** | | | |
| 8,790 % fällig am 09.12.2014 ^ | 29.700 | 0 | 0,00 |
| | | 34.066 | 1,38 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Mexiko Government International Bond** | | | |
| 8,000 % fällig am 07.12.2023 (j) | 568.700 | 30.328 | 1,22 |
| Summe Mexiko | | 64.394 | 2,60 |
| **NIEDERLANDE** | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **Penta CLO BV** | | | |
| 0,790 % fällig am 04.08.2028 € | 250 | 285 | 0,01 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Teva Pharmaceutical Finance Niederlande BV** | | | |
| 0,375 % fällig am 25.07.2020 | 6.600 | 7.395 | 0,30 |
| Summe Niederlande | | 7.680 | 0,31 |
| **NIGERIA** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Nigeria Government International Bond** | | | |
| 6,375 % fällig am 12.07.2023 $ | 2.900 | 3.074 | 0,12 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **PERU** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Alicorp SAA** | | | |
| 6,875 % fällig am 17.04.2027 PEN | 20.200 | 6.525 | 0,26 |
| **Banco de Credito del Peru** | | | |
| 4,850 % fällig am 30.10.2020 PEN | 46.600 | $ 14.262 | 0,58 |
| | | 20.787 | 0,84 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Fondo MIVIVIENDA S.A.** | | | |
| 7,000 % fällig am 14.02.2024 | 39.000 | 12.855 | 0,52 |
| **Peru Government International Bond** | | | |
| 5,700 % fällig am 12.08.2024 | 29.700 | 9.822 | 0,40 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 (j) | 196.438 | 65.211 | 2,63 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | 82.953 | 27.759 | 1,12 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 (j) | 169.400 | 57.871 | 2,34 |
| 6,850 % fällig am 12.02.2042 | 2.460 | 875 | 0,03 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | 47.100 | 16.805 | 0,68 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 (j) | 218.828 | 82.804 | 3,35 |
| | | 274.002 | 11,07 |
| Summe Peru | | 294.789 | 11,91 |
| **PHILIPPINEN** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Philippinen Government International Bond** | | | |
| 3,900 % fällig am 26.11.2022 PHP | 333.000 | 6.339 | 0,26 |
| 4,950 % fällig am 15.01.2021 | 218.000 | 4.286 | 0,17 |
| Summe Philippinen | | 10.625 | 0,43 |
| **POLEN** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Polen Government International Bond** | | | |
| 2,250 % fällig am 25.04.2022 (j) PLN | 45.200 | 12.301 | 0,50 |
| 2,500 % fällig am 25.04.2024 (j) | 29.500 | 8.103 | 0,33 |
| 2,500 % fällig am 25.07.2026 (j) | 139.500 | 38.051 | 1,54 |
| 2,500 % fällig am 25.07.2027 (j) | 44.100 | 11.986 | 0,48 |
| 2,750 % fällig am 25.10.2029 (j) | 88.000 | 24.381 | 0,99 |
| 3,250 % fällig am 25.07.2025 (j) | 155.300 | 44.311 | 1,79 |
| 4,000 % fällig am 25.10.2023 (j) | 55.600 | 16.190 | 0,65 |
| 5,750 % fällig am 23.09.2022 (j) | 135.680 | 40.894 | 1,65 |
| Summe Polen | | 196.217 | 7,93 |
| **KATAR** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 $ | 175 | 205 | 0,01 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | |
| 7,900 % fällig am 05.07.2024 (b)(i)(j) IDR | 178.300.000 | 12.658 | 0,51 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2019 $ | 3.400 | 3.432 | 0,14 |
| | | 16.295 | 0,66 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | |
| **State Of Katar** | | | |
| 2,983 % fällig am 21.12.2020 | 30.000 | 29.925 | 1,21 |
| Summe Katar | | 46.220 | 1,87 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Rumänien Government International Bond** | | | | |
| 4,500 % fällig am 17.06.2024 | RON | 106.500 | $ 26.028 | 1,05 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Russland Government International Bond** | | | | |
| 6,400 % fällig am 27.05.2020 | RUB | 377.300 | 5.961 | 0,24 |
| 6,900 % fällig am 23.05.2029 | | 1.223.200 | 18.908 | 0,76 |
| 7,050 % fällig am 19.01.2028 | | 471.000 | 7.380 | 0,30 |
| 7,250 % fällig am 10.05.2034 | | 667.600 | 10.451 | 0,42 |
| 7,400 % fällig am 07.12.2022 | | 497.300 | 7.951 | 0,32 |
| 7,500 % fällig am 18.08.2021 | | 681.600 | 10.917 | 0,44 |
| 7,600 % fällig am 14.04.2021 | | 273.200 | 4.371 | 0,18 |
| 7,600 % fällig am 20.07.2022 | | 114.200 | 1.837 | 0,07 |
| 7,650 % fällig am 10.04.2030 | | 539.100 | 8.766 | 0,35 |
| 7,700 % fällig am 23.03.2033 | | 1.474.700 | 24.016 | 0,97 |
| 7,750 % fällig am 16.09.2026 | | 357.100 | 5.820 | 0,24 |
| 7,950 % fällig am 07.10.2026 | | 5.094.800 | 83.835 | 3,39 |
| 8,500 % fällig am 17.09.2031 | | 1.795.200 | 31.124 | 1,26 |
| Summe Russland | | | 221.337 | 8,94 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Eskom Holdings SOC Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.08.2027 (e) | ZAR | 100.100 | 2.328 | 0,09 |
| 0,000 % fällig am 31.12.2032 (e) | | 254.000 | 2.831 | 0,11 |
| 7,850 % fällig am 02.04.2026 | | 235.000 | 15.469 | 0,63 |
| **Transnet SOC Ltd.** | | | | |
| 10,000 % fällig am 30.03.2029 | | 40.000 | 2.919 | 0,12 |
| | | | 23.547 | 0,95 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 6,750 % fällig am 31.03.2021 | | 5.100 | 364 | 0,02 |
| 7,000 % fällig am 28.02.2031 | | 380.246 | 23.108 | 0,93 |
| 7,750 % fällig am 28.02.2023 | | 222.100 | 16.010 | 0,65 |
| 8,000 % fällig am 31.01.2030 | | 677.600 | 45.402 | 1,83 |
| 8,250 % fällig am 31.03.2032 | | 599.680 | 39.609 | 1,60 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2037 | | 262.400 | 16.987 | 0,69 |
| 8,750 % fällig am 31.01.2044 | | 115.100 | 7.448 | 0,30 |
| 8,875 % fällig am 28.02.2035 | | 370.100 | 25.051 | 1,01 |
| 9,000 % fällig am 31.01.2040 (j) | | 229.400 | 15.337 | 0,62 |
| 10,500 % fällig am 21.12.2026 | | 549.500 | 44.175 | 1,79 |
| | | | 233.491 | 9,44 |
| Summe Südafrika | | | 257.038 | 10,39 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 6,360 % fällig am 14.02.2023 | IDR | 96.100.000 | $ 6.617 | 0,27 |
| 7,250 % fällig am 07.12.2024 | | 95.500.000 | 6.808 | 0,28 |
| 8,000 % fällig am 15.05.2024 | | 35.300.000 | 2.583 | 0,10 |
| 8,400 % fällig am 30.11.2021 | | 87.200.000 | 6.322 | 0,26 |
| **Korea National Oil Corp.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 08.10.2019 | AUD | 500 | 353 | 0,01 |
| Summe Südkorea | | | 22.683 | 0,92 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | € | 2.050 | 2.526 | 0,10 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Corp. Andina de Fomento** | | | | |
| 6,500 % fällig am 16.03.2023 | IDR | 125.900.000 | 8.645 | 0,35 |
| 6,770 % fällig am 24.05.2028 | COP | 54.500.000 | 16.929 | 0,68 |
| **Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | |
| 6,450 % fällig am 13.12.2022 | IDR | 275.920.000 | 19.488 | 0,79 |
| 9,250 % fällig am 02.12.2020 | | 95.290.000 | 6.967 | 0,28 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 6,950 % fällig am 06.02.2020 | | 58.660.000 | 4.142 | 0,17 |
| 7,200 % fällig am 09.07.2019 | | 101.860.000 | 7.226 | 0,29 |
| **Inter-American Development Bank** | | | | |
| 7,875 % fällig am 14.03.2023 | | 252.200.000 | 18.709 | 0,76 |
| Summe übernational | | | 82.106 | 3,32 |
| **THAILAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Thailand Government International Bond** | | | | |
| 3,650 % fällig am 20.06.2031 | THB | 545.900 | 20.414 | 0,82 |
| 3,775 % fällig am 25.06.2032 | | 1.229.700 | 46.520 | 1,88 |
| 4,875 % fällig am 22.06.2029 | | 9.900 | 401 | 0,02 |
| Summe Thailand | | | 67.335 | 2,72 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Türkei Government International Bond** | | | | |
| 8,000 % fällig am 12.03.2025 | TRY | 85.052 | 10.109 | 0,41 |
| 8,800 % fällig am 27.09.2023 | | 50.100 | 6.596 | 0,27 |
| 9,500 % fällig am 12.01.2022 | | 16.310 | 2.356 | 0,10 |
| 10,600 % fällig am 11.02.2026 | | 37.600 | 5.043 | 0,20 |
| 10,700 % fällig am 17.08.2022 | | 74.300 | 10.845 | 0,44 |
| 11,000 % fällig am 02.03.2022 | | 53.900 | 8.031 | 0,32 |
| 11,000 % fällig am 24.02.2027 | | 161.200 | 21.341 | 0,86 |
| Summe Türkei | | | 64.321 | 2,60 |
| **UKRAINE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.05.2040 (j) | $ | 8.300 | 5.973 | 0,24 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2019 | | 5.300 | 5.327 | 0,21 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2022 | | 4.600 | 4.882 | 0,20 |
| Summe Ukraine | | | 16.182 | 0,65 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADCB Finance Cayman Ltd.** | | | | |
| 8,160 % fällig am 29.04.2029 | IDR | 323.000.000 | 23.337 | 0,94 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | $ | 10.900 | 10.968 | 0,45 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | 34.305 | 1,39 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Standard Chartered Bank** | | | | |
| 9,000 % fällig am 19.03.2029 | IDR | 172.001.000 | $ 13.438 | 0,54 |
| 10,000 % fällig am 17.02.2028 | | 156.000.000 | 12.792 | 0,52 |
| 10,500 % fällig am 19.08.2030 | | 75.338.000 | 6.486 | 0,26 |
| **Ukraine Railways Via Shortline PLC** | | | | |
| 9,875 % fällig am 15.09.2021 | $ | 1.400 | 1.435 | 0,06 |
| **Ukreximbank Via Biz Finance PLC** | | | | |
| 16,500 % fällig am 02.03.2021 | UAH | 104.000 | 3.907 | 0,16 |
| | | | 38.058 | 1,54 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.12.2049 (e) | £ | 0 | 452 | 0,02 |
| 1,584 % fällig am 21.12.2049 | | 6.002 | 7.589 | 0,30 |
| 2,284 % fällig am 21.12.2049 | | 644 | 832 | 0,03 |
| 2,784 % fällig am 21.12.2049 | | 322 | 410 | 0,02 |
| 3,284 % fällig am 21.12.2049 | | 184 | 235 | 0,01 |
| 3,784 % fällig am 21.12.2049 | | 184 | 231 | 0,01 |
| | | | 9.749 | 0,39 |
| Summe Großbritannien | | | 47.807 | 1,93 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.04.2036 | $ | 1.929 | 1.742 | 0,07 |
| **Argent Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.05.2035 | | 695 | 671 | 0,03 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 1.652 | 1.441 | 0,06 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.03.2036 | | 225 | 225 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.12.2036 | | 7.900 | 7.032 | 0,28 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.12.2036 | | 377 | 376 | 0,02 |
| 2,564 % fällig am 25.12.2036 | | 1.873 | 1.275 | 0,05 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 3,439 % fällig am 25.05.2035 | | 3.298 | 3.282 | 0,13 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.11.2037 | | 13.463 | 13.002 | 0,53 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.02.2037 | | 3.200 | 3.153 | 0,13 |
| 3,154 % fällig am 25.11.2035 | | 2.850 | 2.885 | 0,12 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 3,570 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 3.535 | 1.581 | 0,06 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 2,670 % fällig am 25.08.2036 | | 1.928 | 860 | 0,03 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.06.2035 | | 170 | 171 | 0,01 |
| 6,002 % fällig am 25.11.2036 | | 1.501 | 907 | 0,04 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 2,494 % fällig am 25.01.2037 | | 1.237 | 848 | 0,03 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 3,754 % fällig am 25.02.2033 | | 342 | 343 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 5,311 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 2.381 | 2.393 | 0,10 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | | 1.223 | 922 | 0,04 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.11.2036 | | 1.262 | 896 | 0,04 |
| 3,554 % fällig am 25.08.2037 | | 998 | 898 | 0,04 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | | 263 | 216 | 0,01 |
| 3,169 % fällig am 25.01.2035 | | 116 | 115 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.04.2037 | | 2.657 | 2.138 | 0,09 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | | 1.745 | 1.210 | 0,05 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,924 % fällig am 25.09.2035 | $ | 3.700 | $ 3.303 | 0,13 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,714 % fällig am 25.09.2047 | | 1.113 | 1.087 | 0,04 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 2,694 % fällig am 25.12.2035 | | 2.122 | 2.095 | 0,08 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,232 % fällig am 15.12.2033 | € | 464 | 512 | 0,02 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.07.2037 | $ | 1.680 | 1.422 | 0,06 |
| 2,754 % fällig am 25.03.2036 | | 1.300 | 1.275 | 0,05 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.10.2037 | | 6.549 | 4.942 | 0,20 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | | 592 | 595 | 0,02 |
| | | | 63.813 | 2,58 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.04.2021 | | 100 | 102 | 0,01 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.05.2023 (j) | | 200 | 207 | 0,01 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 (j) | | 2.700 | 2.707 | 0,11 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.09.2022 | | 100 | 101 | 0,00 |
| **DXC Technology Co.** | | | | |
| 3,470 % fällig am 01.03.2021 (j) | | 2.538 | 2.538 | 0,10 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 (j) | | 2.300 | 2.342 | 0,10 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 09.01.2023 | | 200 | 202 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 07.01.2021 | | 200 | 206 | 0,01 |
| 4,650 % fällig am 17.10.2021 (j) | | 1.000 | 1.042 | 0,04 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 17.04.2042 | IDR | 60.000.000 | 3.494 | 0,14 |
| 7,375 % fällig am 19.05.2048 | | 162.152.000 | 10.215 | 0,41 |
| 9,000 % fällig am 19.03.2029 | | 156.244.000 | 12.207 | 0,49 |
| 9,500 % fällig am 17.07.2031 | | 29.926.000 | 2.402 | 0,10 |
| 10,500 % fällig am 19.07.2038 | | 60.000.000 | 5.278 | 0,21 |
| **Marsh & McLennan Cos., Inc.** | | | | |
| 3,519 % fällig am 29.12.2021 | $ | 500 | 501 | 0,02 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 17.01.2023 | | 200 | 211 | 0,01 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | | 3.600 | 4.050 | 0,16 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 2.770 | 3.098 | 0,13 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 940 | 1.084 | 0,04 |
| | | | 51.987 | 2,10 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 4,044 % fällig am 25.09.2045 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 4,479 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 2 | 2 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 6,247 % fällig am 26.05.2037 | | 6.327 | 5.618 | 0,23 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 3,939 % fällig am 25.03.2035 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 4,351 % fällig am 25.01.2035 | | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,376 % fällig am 25.03.2035 | | 14 | 15 | 0,00 |
| 4,392 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 28 | 27 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 3,738 % fällig am 25.04.2037 | | 10.508 | 9.201 | 0,37 |
| 4,466 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 649 | 625 | 0,03 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,291 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 6.930 | 6.758 | 0,27 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 5,130 % fällig am 25.03.2034 | $ | 3 | $ 3 | 0,00 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 3,054 % fällig am 25.10.2036 | | 1.218 | 993 | 0,04 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.04.2046 | | 216 | 195 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 1.288 | 794 | 0,03 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,204 % fällig am 25.03.2035 | | 71 | 68 | 0,00 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.01.2036 | | 208 | 182 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,396 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 10 | 10 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | | 217 | 216 | 0,01 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.02.2037 | | 673 | 617 | 0,03 |
| 3,856 % fällig am 25.11.2037 | | 417 | 409 | 0,02 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.03.2056 | | 535 | 521 | 0,02 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 | | 2.786 | 2.745 | 0,11 |
| 2,644 % fällig am 25.06.2047 | | 747 | 677 | 0,03 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.05.2037 | | 3.587 | 2.252 | 0,09 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.03.2037 | | 3.167 | 1.341 | 0,05 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,485 % fällig am 25.06.2036 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 647 | 599 | 0,02 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 4,164 % fällig am 20.01.2038 ^ | | 640 | 610 | 0,02 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.02.2037 | | 1.523 | 1.476 | 0,06 |
| **SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,316 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 1.574 | 1.508 | 0,06 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.05.2034 | | 200 | 182 | 0,01 |
| 4,077 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 43 | 43 | 0,00 |
| 4,229 % fällig am 25.03.2036 | | 2.268 | 2.224 | 0,09 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 4,750 % fällig am 25.10.2036 | | 737 | 735 | 0,03 |
| 4,992 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 9 | 9 | 0,00 |
| | | | 40.668 | 1,64 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 4,468 % fällig am 01.07.2035 | | 20 | 21 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| | | | 214.77 | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 210.100 | 5 | 8,68 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | | 58.500 | 60.448 | 2,44 |
| | | | 275.24 4 | 11,12 |
| Summe USA | | | 431.712 | 17,44 |
| **URUGUAY** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Uruguay Government International Bond** | | | | |
| 9,875 % fällig am 20.06.2022 | UYU | 250.700 | 7.082 | 0,29 |
| Summe Uruguay | | | 7.082 | 0,29 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (k)** | | | | |
| | | | 4.884 | 0,20 |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **JPMorgan Structured Products BV** | | | | |
| 17,436 % fällig am 16.01.2020 (e)(f)(i) | EGP | 250.525 | 13.826 | 0,56 |
| 17,813 % fällig am 14.11.2019 (e)(f)(i) | EGP | 149.425 | $ 8.477 | 0,34 |
| **Nigeria Treasury Bills** | | | | |
| 13,580 % fällig am 14.05.2020 (e)(f) | NGN | 1.600.000 | 3.997 | 0,16 |
| 13,770 % fällig am 04.06.2020 (e)(f) | | 1.500.000 | 3.722 | 0,15 |
| 13,945 % fällig am 06.02.2020 (e)(f) | | 951.300 | 2.455 | 0,10 |
| 14,199 % fällig am 23.04.2020 (e)(f) | | 3.045.900 | 7.659 | 0,31 |
| 14,266 % fällig am 06.02.2020 (e)(f) | | 2.450.000 | 6.322 | 0,26 |
| 16,777 % fällig am 09.01.2020 (e)(f) | | 3.800.000 | 9.901 | 0,40 |
| 17,039 % fällig am 09.01.2020 (e)(f) | | 750.000 | 1.954 | 0,08 |
| 17,101 % fällig am 20.02.2020 (e)(f) | | 1.200.000 | 3.081 | 0,12 |
| | | | 61.394 | 2,48 |
| **ARGENTINIEN TREASURY BILLS** | | | | |
| 2,709 % fällig am 31.07.2020 (e)(f) | ARS | 629.150 | 14.385 | 0,58 |
| 9,730 % fällig am 28.02.2020 (e)(f) | | 67.700 | 1.571 | 0,06 |
| 10,244 % fällig am 19.07.2019 (e)(f) | | 20.441 | 522 | 0,02 |
| | | | 16.478 | 0,66 |
| **ÄGYPTEN TREASURY BILLS** | | | | |
| 17,150 % fällig am 22.10.2019 (e)(f) | EGP | 11.075 | 629 | 0,03 |
| 17,250 % fällig am 12.05.2020 (e)(f) | | 338.800 | 17.651 | 0,71 |
| 17,500 % fällig am 31.12.2019 (e)(f) | | 8.700 | 480 | 0,02 |
| 18,250 % fällig am 30.07.2019 (e)(f) | | 9.225 | 545 | 0,02 |
| 18,351 % fällig am 12.11.2019 (e)(f) | | 36.725 | 2.068 | 0,08 |
| 19,207 % fällig am 24.12.2019 (e)(f) | | 165.600 | 9.153 | 0,37 |
| 19,534 % fällig am 07.01.2020 (e)(f) | | 83.100 | 4.565 | 0,19 |
| | | | 35.091 | 1,42 |
| **NIGERIA TREASURY BILLS** | | | | |
| 13,729 % fällig am 28.05.2020 (e)(f) | NGN | 2.950.000 | 7.344 | 0,30 |
| 13,793 % fällig am 28.05.2020 (e)(f) | | 2.000.000 | 4.979 | 0,20 |
| 13,798 % fällig am 28.05.2020 (e)(f) | | 1.150.000 | 2.863 | 0,12 |
| 13,926 % fällig am 28.05.2020 (e)(f) | | 750.000 | 1.867 | 0,07 |
| 14,179 % fällig am 27.02.2020 (e)(f) | | 1.393.400 | 3.568 | 0,14 |
| 14,180 % fällig am 02.04.2020 (e)(f) | | 1.966.800 | 4.980 | 0,20 |
| 14,320 % fällig am 16.04.2020 (e)(f) | | 1.966.900 | 4.962 | 0,20 |
| 16,127 % fällig am 27.02.2020 (e)(f) | | 2.800.000 | 7.171 | 0,29 |
| 16,324 % fällig am 27.02.2020 (e)(f) | | 1.150.000 | 2.945 | 0,12 |
| 16,399 % fällig am 27.02.2020 (e)(f) | | 6.650.000 | 17.031 | 0,69 |
| 16,830 % fällig am 16.01.2020 (e)(f) | | 1.800.000 | 4.679 | 0,19 |
| 17,361 % fällig am 30.01.2020 (e)(f) | | 970.950 | 2.511 | 0,10 |
| 17,404 % fällig am 30.01.2020 (e)(f) | | 924.769 | 2.391 | 0,10 |
| 17,514 % fällig am 30.01.2020 (e)(f) | | 991.000 | 2.563 | 0,10 |
| | | | 69.854 | 2,82 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 187.701 | 7,58 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| PIMCO Select Fund - plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h) | 311.828 | $ 3.123 | 0,13 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 3.131.994** | **126,54** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1.069 | $ 1.857 | 0,08 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 450 | 354 | 0,01 |
| | | | | $ 2.211 | 0,09 |

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | $ 112,000 | 23.08.2019 | 450 | $ 4 | $ 1 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 146,500 | 23.08.2019 | 20 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 108,000 | 23.08.2019 | 1.069 | 9 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 13 | $ 2 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 2.213** | **0,09** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| General Electric Co. | 1,000 % | 20.12.2020 | $ 300 | $ 12 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 1.100 | 62 | 0,01 |
| | | | | $ 74 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $242.700 | $ 1.049 | 0,04 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,250 % | 02.01.2020 | BRL 1.933.400 | $ (602) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,885 | 04.01.2021 | 287.000 | 1.065 | 0,04 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,910 | 04.01.2021 | 397.600 | (1.504) | (0,06) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 6,930 | 04.01.2021 | 218.500 | 124 | 0,01 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,983 | 04.01.2021 | 268.900 | (1.176) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,050 | 04.01.2021 | 306.900 | 1.325 | 0,05 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,095 | 04.01.2021 | 210.600 | 1.007 | 0,04 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,184 | 04.01.2021 | 128.300 | 672 | 0,03 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,190 | 04.01.2021 | 90.600 | (39) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,220 | 04.01.2021 | 225.100 | 1.213 | 0,05 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,255 | 04.01.2021 | 193.400 | (1.025) | (0,04) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 7,290 | 04.01.2021 | 501.200 | (2.726) | (0,11) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,420 | 03.01.2022 | 194.600 | 285 | 0,01 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,480 | 02.01.2025 | 119.400 | 604 | 0,02 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,800 % | 04.01.2027 | BRL 106.600 | $ 611 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,830 | 04.01.2021 | 260.100 | 2.232 | 0,09 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,635 | 04.01.2027 | 65.500 | (1.046) | (0,04) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,640 | 04.01.2027 | 105.900 | 1.293 | 0,05 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,675 | 04.01.2027 | 19.900 | (329) | (0,01) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,790 | 04.01.2021 | 2.400 | 26 | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,020 | 02.01.2023 | 98.600 | 2.248 | 0,09 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,490 | 04.01.2027 | 104.000 | 2.708 | 0,11 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 9,600 | 04.01.2027 | 48.900 | (1.789) | (0,07) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,750 | 02.01.2025 | 17.400 | 549 | 0,02 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,760 | 02.01.2025 | 51.200 | 1.692 | 0,07 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,135 | 01.07.2021 | 70.500 | 1.295 | 0,05 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 10,240 | 04.01.2027 | 67.300 | (1.152) | (0,05) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,300 | 02.01.2025 | 50.300 | 1.682 | 0,07 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 10,300 | 04.01.2027 | 120.500 | (4.200) | (0,17) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,860 | 02.01.2023 | 115.200 | 4.508 | 0,18 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 11,350 | 04.01.2021 | 2.200 | (22) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 11,380 | 02.01.2020 | 462.700 | 5.886 | 0,24 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,800 | 04.01.2021 | 18.490 | 640 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,850 | 04.01.2021 | 78.220 | 2.835 | 0,11 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 16,390 | 04.01.2021 | 14.300 | 282 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month PLN-WIBOR | 1,750 | 16.09.2020 | PLN 5.300 | 19 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month PLN-WIBOR | 1,833 | 31.01.2022 | 28.400 | 16 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month PLN-WIBOR | 1,833 | 05.02.2022 | 145.900 | 79 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month PLN-WIBOR | 1,942 | 20.03.2024 | 44.900 | 152 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month PLN-WIBOR | 2,000 | 19.09.2020 | 6.300 | 22 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month PLN-WIBOR | 2,250 | 20.03.2024 | 41.200 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month PLN-WIBOR | 2,250 | 19.06.2024 | 40.000 | 115 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month PLN-WIBOR | 2,500 | 16.03.2026 | 23.600 | (331) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | $ 73.090 | (6.363) | (0,26) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 21.12.2046 | 1.800 | 140 | 0,01 |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 18.12.2024 | 44.000 | (219) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 15.06.2046 | 1.000 | (13) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 16.12.2045 | 1.700 | (151) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 31.810 | (2.534) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2028 | 27.400 | (2.524) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 18.820 | (981) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 6,500 | 22.03.2020 | ZAR 200 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,250 | 19.09.2023 | 142.300 | 280 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,750 | 15.03.2022 | 75.000 | 146 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,750 | 19.09.2028 | 137.400 | (120) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,750 | 16.03.2021 | 393.400 | 899 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 9,500 | 16.09.2026 | 53.400 | (73) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,781 | 04.02.2024 | CZK 341.600 | 48 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,250 | 19.06.2021 | 3.755.100 | 650 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,250 | 19.12.2023 | 1.015.800 | 1.994 | 0,08 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,465 | 19.12.2023 | 37.200 | (76) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 0,800 | 14.06.2022 | HUF 14.350.000 | 10 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,500 | 19.06.2024 | 8.026.600 | 720 | 0,03 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,000 | 19.06.2021 | ¥ 32.530.000 | (35) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,000 | 22.02.2023 | MXN 206.320 | (429) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,500 | 22.02.2023 | 240.700 | (589) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,000 | 22.02.2023 | 160.800 | 204 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,650 | 24.02.2023 | 842.300 | 359 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,675 | 04.06.2029 | 40.500 | 17 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,720 | 24.03.2023 | 1.797.500 | (1.370) | (0,06) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,730 | 23.03.2023 | 6.500 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,830 | 15.12.2022 | 395.300 | 291 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,856 | 15.12.2022 | 381.800 | 343 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,865 | 13.05.2024 | 550.800 | (691) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,875 | 16.12.2022 | 55.900 | 52 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,880 | 27.12.2022 | 505.000 | 295 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,885 | 27.05.2039 | 470.900 | 38 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,910 | 07.12.2023 | 546.000 | (700) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,920 | 28.12.2023 | 144.400 | 106 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,977 | 17.03.2028 | 942.600 | 1.604 | 0,07 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,990 | 16.03.2028 | 3.000 | 5 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,103 | 04.01.2038 | 6.300 | (9) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,110 | 03.05.2029 | 400.300 | (843) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,135 | 07.05.2029 | 326.100 | 714 | 0,03 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,155 | 19.04.2029 | 95.700 | 223 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,260 | 28.05.2020 | 1.722.600 | (145) | (0,01) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,290 | 14.05.2020 | 1.572.000 | (125) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,320 | 07.01.2032 | 195.200 | 410 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,385 | 01.06.2020 | 1.722.600 | 250 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,390 | 31.05.2029 | 559.600 | 1.845 | 0,07 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,818 | 16.11.2023 | 1.191.500 | 3.684 | 0,15 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,910 | 15.11.2023 | 602.400 | 1.975 | 0,08 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,980 | 23.11.2023 | 1.096.000 | 3.157 | 0,13 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 9,100 % | 09.11.2028 | MXN 722.200 | $ (4.165) | (0,17) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 9,210 | 08.11.2028 | 477.700 | (2.875) | (0,12) |
| | | | | | $ 14.657 | 0,59 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 15.780** | **0,64** |

(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) Das zugrunde liegende 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

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC USD versus MXN | MXN 23,500 | 03.07.2019 | 35.000 | $ 3 | $ 0 | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus PLN | PLN 4,200 | 16.07.2019 | 15.000 | 2 | 1 | 0,00 |
| BPS | Call - OTC USD versus MXN | MXN 23,000 | 17.07.2019 | 100.000 | 10 | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ 15 | $ 2 | 0,00 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 % | 21.08.2019 | 25.800 | $ (31) | $ (5) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 25.300 | (28) | (8) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 8.300 | (9) | (2) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 3.800 | (6) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 50.900 | (51) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 37.700 | (44) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 2.900 | € (6) | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 27.100 | $ (27) | (5) | 0,00 |
| | | | | | | $ (202) | $ (40) | 0,00 |

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Call - OTC USD versus TRY | TRY 13,000 | 26.08.2020 | 10.300 | $ (857) | $ (188) | (0,02) |
| CBK | Call - OTC EUR versus RON | RON 4,900 | 29.07.2019 | 24.100 | (104) | (8) | 0,01 |
| DUB | Call - OTC USD versus TRY | TRY 13,000 | 27.08.2020 | 9.800 | (869) | (180) | (0,01) |
| FBF | Call - OTC USD versus TRY | 13,000 | 26.08.2020 | 9.900 | (765) | (181) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC USD versus COP | COP 3.490,000 | 21.08.2019 | 27.900 | (209) | (28) | 0,00 |
| | | | | | $ (2.804) | $ (585) | (0,03) |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag(2) | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Peru Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2020 | $ 200 | $ (8) | $ 10 | $ 2 | 0,00 |
| | Türkei Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | € 22.400 | (492) | 181 | (311) | (0,01) |
| BPS | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | $ 2.200 | 0 | 7 | 7 | 0,00 |
| | Mexiko Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 3.600 | 10 | 3 | 13 | 0,00 |
| CBK | Mexiko Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 3.400 | 13 | (1) | 12 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 5.800 | 9 | 11 | 20 | 0,00 |
| DUB | Ägypten Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 3.400 | (99) | 70 | (29) | 0,00 |
| | Mexiko Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 1.900 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| FBF | Ägypten Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 6.900 | (588) | 344 | (244) | (0,01) |
| GST | Chile Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 4.000 | 11 | 35 | 46 | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.06.2021 | 1.200 | (12) | (24) | (36) | 0,00 |
| HUS | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.09.2019 | 15.400 | 24 | 1 | 25 | 0,00 |
| | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 40.700 | 76 | 93 | 169 | 0,01 |
| | Türkei Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 6.100 | (141) | 56 | (85) | (0,01) |

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | | | | | | | | |
| | Nigeria Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | $ 11.100 | $ (143) | $ 61 | $ (82) | 0,00 |
| | Panama Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 5.500 | (24) | 142 | 118 | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.06.2021 | 1.200 | (12) | (24) | (36) | 0,00 |
| | Türkei Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 2.800 | (62) | 23 | (39) | 0,00 |
| | Türkei Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 5.600 | (439) | 207 | (232) | (0,01) |
| NGF | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 12.600 | (25) | 62 | 37 | 0,00 |
| | | | | | $ (1.895) | $ 1.257 | $ (638) | (0,03) |

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

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

## 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 USD-LIBOR abzgl. 0,223 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 24.07.2020 | $ 5.060 | TRY 29.500 | $ 5 | $ (140) | $ (135) | 0,00 |
| DUB | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR abzgl. 0,224 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 24.07.2020 | 4.863 | 28.500 | (20) | (139) | (159) | (0,01) |
| GLM | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR abzgl. 0,223 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 16.04.2024 | TRY 11.800 | $ 2.042 | 14 | 433 | 447 | 0,02 |
| | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR abzgl. 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) | (125) | (128) | (0,01) |
| | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR abzgl. 0,330 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month ARS-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 28.05.2024 | 1.900 | 85.633 | 0 | (89) | (89) | (0,00) |
| | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR abzgl. 0,332 % 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) | (153) | (168) | (0,01) |
| HUS | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR abzgl. 0,197 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 27.08.2020 | TRY 55.713 | $ 11.607 | (19) | (461) | (480) | (0,01) |
| | | | | | | $ (38) | $ (674) | $ (712) | (0,02) |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/- (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,220 % | 23.11.2020 | THB 39.800 | $ 0 | $ 12 | $ 12 | 0,00 |
| BOA | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | ILS 65.700 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,285) | 16.02.2020 | 100.800 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,963 | 16.02.2028 | 21.300 | (2) | 357 | 355 | 0,01 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 13.700 | 0 | 207 | 207 | 0,01 |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (6,050) | 15.02.2029 | COP 20.738.000 | 0 | (433) | (433) | (0,02) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,340) | 26.02.2024 | 41.426.000 | 0 | (478) | (478) | (0,02) |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,310 | 29.08.2019 | 13.850.000 | 0 | 14 | 14 | 0,00 |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | (3,740) | 25.09.2022 | MYR 56.900 | 0 | (175) | (175) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,833 | 19.06.2026 | THB 304.900 | 0 | 74 | 74 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,920 | 19.06.2024 | 219.000 | 0 | 97 | 97 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,320 | 27.07.2020 | 417.700 | 0 | 353 | 353 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,490 | 14.01.2021 | 450.000 | 0 | 563 | 563 | 0,02 |
| BPS | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (6,050) | 13.02.2029 | COP 29.664.000 | 0 | (620) | (620) | (0,03) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,980) | 12.02.2029 | 14.523.000 | 0 | (279) | (279) | (0,01) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,960) | 11.01.2029 | 52.855.500 | 16 | (1.037) | (1.021) | (0,04) |

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,340) % | 13.02.2024 | COP 25.330.000 | $ 0 | $ (296) | $ (296) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,260 | 18.06.2022 | 29.455.000 | 0 | 14 | 14 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,240 | 29.04.2024 | 22.402.000 | 0 | 233 | 233 | 0,01 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,960 | 21.06.2026 | 20.919.500 | 0 | 435 | 435 | 0,02 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,390 | 19.12.2028 | THB 365.000 | 0 | 587 | 587 | 0,02 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,417 | 19.12.2028 | 365.000 | 0 | 615 | 615 | 0,02 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,385 | 23.01.2021 | 139.200 | 0 | 165 | 165 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,415 | 21.01.2021 | 104.710 | 0 | 126 | 126 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,480 | 14.01.2021 | 4.300 | 0 | 5 | 5 | 0,00 |
| BRC | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,374) | 20.06.2020 | ILS 160.200 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,950 | 20.06.2028 | 34.500 | 0 | 482 | 482 | 0,02 |
| BSH | Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | (3,300) | 21.06.2029 | CLP 3.450.000 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | (2,910) | 06.06.2023 | 10.000.000 | 0 | (174) | (174) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,750 | 22.03.2026 | 8.000.000 | 0 | 588 | 588 | 0,02 |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,790 | 14.03.2026 | 3.885.000 | 7 | 296 | 303 | 0,01 |
| CBK | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,950) | 23.05.2024 | ILS 122.500 | 0 | (344) | (344) | (0,01) |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,041 | 15.05.2024 | 101.800 | 0 | 421 | 421 | 0,02 |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,990) | 14.01.2029 | COP 29.739.900 | (4) | (590) | (594) | (0,02) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,960) | 10.05.2029 | 27.236.900 | 0 | (502) | (502) | (0,02) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,880) | 20.05.2029 | 15.082.000 | 0 | (245) | (245) | (0,01) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,340) | 26.02.2024 | 22.013.800 | 0 | (254) | (254) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,582 | 18.06.2024 | 23.125.000 | 0 | 12 | 12 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,840 | 22.03.2021 | 31.343.900 | 0 | 133 | 133 | 0,01 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,120 | 11.12.2021 | 28.475.100 | 0 | 210 | 210 | 0,01 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,255 | 29.04.2024 | 19.370.000 | 0 | 206 | 206 | 0,01 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,770 | 26.03.2029 | 21.443.400 | 0 | 283 | 283 | 0,01 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,780 | 07.06.2026 | 66.137.000 | 0 | 1.166 | 1.166 | 0,05 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 6,395 | 24.10.2028 | 10.316.600 | 0 | 309 | 309 | 0,01 |
| | Erhalt | 3-Month MYR-KLIBOR | (3,750) | 26.09.2022 | MYR 88.100 | 0 | (278) | (278) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,763 | 24.05.2029 | CLP 1.841.700 | 11 | 105 | 116 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,770 | 19.03.2026 | 64.800 | 0 | 5 | 5 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,932 | 19.06.2024 | THB 89.100 | 0 | 41 | 41 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,625 | 27.07.2025 | 97.500 | 0 | 185 | 185 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,810 | 23.09.2025 | 128.180 | 0 | 287 | 287 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,410 | 15.01.2021 | 105.700 | 0 | 127 | 127 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,420 | 17.01.2021 | 328.450 | 0 | 399 | 399 | 0,02 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,520 | 13.01.2021 | 68.600 | 0 | 87 | 87 | 0,00 |
| DUB | Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,238 | 04.01.2021 | BRL 123.500 | 0 | 696 | 696 | 0,03 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,590) | 11.10.2020 | ILS 211.100 | 0 | (415) | (415) | (0,02) |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,414) | 20.06.2020 | 66.300 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 2,100 | 20.06.2028 | 14.000 | 0 | 246 | 246 | 0,01 |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (6,445) | 01.07.2025 | COP 10.000.000 | 0 | (305) | (305) | (0,01) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,345) | 14.02.2024 | 9.986.000 | 0 | (117) | (117) | 0,00 |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,300) | 12.02.2024 | 27.524.000 | 0 | (307) | (307) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,910 | 16.03.2021 | 21.500.400 | 0 | 99 | 99 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,171 | 21.05.2024 | 178.755.000 | 0 | 1.645 | 1.645 | 0,07 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,015 | 17.08.2020 | THB 86.000 | 0 | 18 | 18 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,580 | 19.10.2025 | 76.700 | 0 | 134 | 134 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,390 | 23.01.2021 | 139.000 | 0 | 165 | 165 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,410 | 15.01.2021 | 105.700 | 0 | 127 | 127 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,410 | 21.01.2021 | 100.550 | 0 | 121 | 121 | 0,00 |
| FBF | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,270 | 18.03.2021 | CLP 12.180.000 | 0 | 296 | 296 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,780 | 23.09.2025 | THB 20.740 | 0 | 45 | 45 | 0,00 |
| GLM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,960) | 24.05.2024 | ILS 213.800 | 0 | (629) | (629) | (0,03) |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,950) | 23.05.2024 | 93.600 | 0 | (263) | (263) | (0,01) |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | 132.300 | 10 | (34) | (24) | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,290) | 16.02.2020 | 207.300 | 2 | (44) | (42) | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,270) | 21.03.2020 | 133.500 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,048 | 27.02.2024 | 167.400 | 0 | 861 | 861 | 0,03 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,407 | 10.12.2023 | 155.700 | 0 | 1.716 | 1.716 | 0,07 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,883 | 21.03.2028 | 28.100 | 0 | 398 | 398 | 0,02 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,897 | 17.12.2025 | 57.400 | 0 | 1.069 | 1.069 | 0,04 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,971 | 16.02.2028 | 43.600 | (3) | 738 | 735 | 0,03 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 28.300 | 0 | 428 | 428 | 0,02 |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (6,430) | 01.07.2025 | COP 9.970.000 | 0 | (302) | (302) | (0,01) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,338) | 14.02.2024 | 85.658.000 | (4) | (995) | (999) | (0,04) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (4,880) | 07.06.2024 | 120.371.100 | (8) | (580) | (588) | (0,02) |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,170 | 25.01.2023 | 91.148.400 | 0 | 873 | 873 | 0,04 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,170 | 23.05.2024 | 68.038.100 | 0 | 624 | 624 | 0,03 |
| | Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | (3,015) | 20.06.2026 | CLP 5.555.000 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,265 | 14.06.2029 | 4.122.200 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,455 | 02.06.2022 | 8.596.000 | 0 | 379 | 379 | 0,02 |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,535 | 14.11.2022 | 3.595.100 | 0 | 183 | 183 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,830 | 22.05.2029 | 7.729.900 | 0 | 561 | 561 | 0,02 |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,095 | 01.06.2027 | 12.230.000 | 0 | 1.324 | 1.324 | 0,05 |
| | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 4,319 | 22.05.2029 | 19.808.000 | 0 | 553 | 553 | 0,02 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,175 | 19.06.2029 | THB 4.900 | 0 | 5 | 5 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,186 | 19.06.2029 | 154.500 | 0 | 160 | 160 | 0,01 |
| GST | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,333 | 19.06.2021 | MYR 30.600 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| HUS | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | ILS 69.400 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,017 | 11.03.2024 | 82.600 | 0 | 382 | 382 | 0,02 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,017 | 15.05.2024 | 116.300 | 0 | 443 | 443 | 0,02 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Local Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 % | 20.06.2028 | ILS 14.900 | $ 1 | $ 224 | $ 225 | 0,01 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,990 | 08.06.2023 | THB 1.647.500 | 0 | 800 | 800 | 0,03 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,040 | 17.08.2020 | 320.000 | 0 | 70 | 70 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,110 | 26.01.2022 | 101.200 | 0 | 53 | 53 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,195 | 19.06.2029 | 37.000 | 0 | 39 | 39 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,545 | 26.01.2027 | 534.700 | 0 | 1.049 | 1.049 | 0,04 |
| JPM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,420) | 20.06.2020 | ILS 58.300 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,027 | 19.03.2024 | 37.000 | 0 | 172 | 172 | 0,01 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,095 | 10.05.2024 | 19.800 | 0 | 98 | 98 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 2,078 | 20.06.2028 | 12.600 | 0 | 215 | 215 | 0,01 |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (6,390) | 21.11.2028 | COP 23.016.500 | 0 | (674) | (674) | (0,03) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (6,320) | 10.12.2028 | 10.292.000 | 0 | (280) | (280) | (0,01) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,960) | 11.02.2029 | 39.451.000 | 0 | (740) | (740) | (0,03) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,630) | 07.02.2026 | 39.127.000 | 0 | (605) | (605) | (0,02) |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (4,880) | 07.06.2024 | 59.860.200 | 0 | (292) | (292) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,607 | 17.06.2024 | 39.043.600 | 0 | 35 | 35 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,840 | 22.03.2021 | 67.355.000 | 0 | 286 | 286 | 0,01 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,230 | 28.05.2020 | 12.870.000 | 0 | 48 | 48 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,250 | 23.04.2024 | 25.341.200 | 0 | 269 | 269 | 0,01 |
| | Erhalt | 6-Month CLP-CHILIBOR | (3,540) | 04.06.2029 | CLP 4.115.000 | 0 | (138) | (138) | (0,01) |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,950 | 19.06.2029 | THB 282.300 | 0 | 97 | 97 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 3,320 | 29.07.2020 | 131.800 | 0 | 111 | 111 | 0,00 |
| MYC | Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,800 | 04.01.2027 | BRL 12.200 | 17 | 67 | 84 | 0,00 |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (6,420) | 02.07.2025 | COP 6.640.000 | 0 | (200) | (200) | (0,01) |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,795 | 03.03.2020 | 13.765.000 | 0 | 24 | 24 | 0,00 |
| | | | | | | $ 43 | $ 14.368 | $ 14.411 | 0,58 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | COP | 3.252 | $ | 1 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 117 | | 133 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 4.108 | | 1.231 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 07/2019 | TWD | 88.350 | | 2.795 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 27.164 | CLP | 18.433.765 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 792 | HUF | 225.059 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 9.252 | ZAR | 134.466 | 277 | 0 | 277 | 0,01 |
| | 07/2019 | ZAR | 52.994 | $ | 3.736 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08/2019 | CZK | 116.405 | | 5.113 | 0 | (102) | (102) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.193 | CHF | 1.192 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 620 | CZK | 14.163 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 24.139 | € | 21.275 | 174 | 0 | 174 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 155 | RUB | 10.194 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | ILS | 17.279 | $ | 4.853 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 20.815 | IDR | 301.505.275 | 323 | 0 | 323 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 493 | KRW | 579.472 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 5.612 | UAH | 151.729 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 132.974 | $ | 4.240 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| | 11/2019 | $ | 10.868 | KZT | 4.240.718 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 01/2020 | NGN | 856.162 | $ | 2.173 | 0 | (129) | (129) | (0,01) |
| | 03/2020 | RON | 28.675 | € | 5.781 | 0 | (136) | (136) | (0,01) |
| BPS | 07/2019 | ARS | 274.899 | $ | 6.002 | 0 | (346) | (346) | (0,01) |
| | 07/2019 | BRL | 58.148 | | 14.960 | 0 | (212) | (212) | (0,01) |
| | 07/2019 | CLP | 8.151.278 | | 11.699 | 0 | (312) | (312) | (0,01) |
| | 07/2019 | COP | 27.092.412 | | 8.331 | 0 | (114) | (114) | 0,00 |
| | 07/2019 | IDR | 240.143.895 | | 16.750 | 0 | (232) | (232) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 114.100 | | 1.060 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 30.522 | | 9.194 | 0 | (84) | (84) | 0,00 |
| | 07/2019 | PLN | 19.778 | | 5.289 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | RON | 135.439 | | 32.046 | 0 | (554) | (554) | (0,02) |
| | 07/2019 | TRY | 31.564 | | 5.456 | 3 | (1) | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.272 | ARS | 63.215 | 168 | 0 | 168 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 5.882 | BRL | 22.616 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 453 | CLP | 308.269 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 13.902 | COP | 44.417.181 | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 21.523 | £ | 16.969 | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.055 | PEN | 13.420 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 7.606 | TRY | 44.433 | 33 | (2) | 31 | 0,00 |
| | 08/2019 | ARS | 486.101 | $ | 10.892 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08/2019 | BRL | 18.794 | | 4.873 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 16.969 | | 21.556 | 0 | (74) | (74) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 5.215 | ARS | 269.185 | 767 | 0 | 767 | 0,03 |
| | 08/2019 | | 23.934 | € | 21.137 | 222 | 0 | 222 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 430 | MXN | 8.328 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | CLP | 308.269 | $ | 453 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | CNY | 60.819 | | 8.780 | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR | 11.319.157 | | 793 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 29.548.198 | | 24.923 | 0 | (658) | (658) | (0,03) |
| | 09/2019 | $ | 16.574 | IDR | 240.143.895 | 262 | 0 | 262 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09/2019 | $ | 12.353 | KRW | 14.508.599 | $ 207 | $ 0 | $ 207 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 4.060 | PEN | 13.420 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 10/2019 | COP | 44.417.181 | $ | 13.828 | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 19.350 | | 4.517 | 0 | (130) | (130) | (0,01) |
| | 12/2019 | TRY | 103.537 | | 16.118 | 0 | (376) | (376) | (0,02) |
| | 03/2020 | RON | 24.998 | € | 5.034 | 0 | (125) | (125) | (0,01) |
| | 08/2020 | TRY | 21.044 | $ | 2.234 | 0 | (764) | (764) | (0,03) |
| BRC | 07/2019 | COP | 20.994.862 | | 6.454 | 0 | (90) | (90) | 0,00 |
| | 07/2019 | HUF | 14.097.514 | | 49.472 | 0 | (308) | (308) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 7.355 | CLP | 5.006.795 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.739 | MYR | 7.311 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.172 | PEN | 3.915 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 283.976 | $ | 19.437 | 0 | (686) | (686) | (0,03) |
| | 08/2019 | AUD | 486 | | 338 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 61.522 | | 3.097 | 0 | (83) | (83) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 597 | CZK | 13.791 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 09/2019 | CLP | 4.999.877 | $ | 7.348 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR | 180.405.749 | | 12.582 | 0 | (66) | (66) | 0,00 |
| | 09/2019 | MYR | 1.022 | | 246 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 3.935 | MYR | 16.258 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 9.041 | THB | 278.416 | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| BSS | 07/2019 | CLP | 14.308.537 | $ | 20.595 | 0 | (483) | (483) | (0,02) |
| | 05/2020 | $ | 1.925 | ARS | 144.180 | 400 | 0 | 400 | 0,02 |
| CBK | 07/2019 | BRL | 27.834 | $ | 7.209 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 07/2019 | CLP | 16.568.522 | | 23.674 | 0 | (739) | (739) | (0,03) |
| | 07/2019 | COP | 10.710.571 | | 3.363 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07/2019 | HUF | 1.257.726 | | 4.384 | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 284.118 | | 85.311 | 0 | (1.067) | (1.067) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 6.026 | CLP | 4.098.379 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.555 | COP | 5.187.480 | 62 | 0 | 62 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 523 | HUF | 149.788 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 52.417 | PEN | 172.808 | 125 | 0 | 125 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 936 | RUB | 60.540 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 7.940 | ZAR | 118.388 | 449 | 0 | 449 | 0,02 |
| | 08/2019 | € | 51.099 | $ | 57.383 | 0 | (1.014) | (1.014) | (0,04) |
| | 08/2019 | PEN | 9.476 | | 2.817 | 0 | (61) | (61) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 727 | CZK | 16.547 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 23.453 | € | 20.669 | 169 | 0 | 169 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 1.230 | MXN | 23.771 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | COP | 12.745.761 | $ | 3.789 | 0 | (165) | (165) | (0,01) |
| | 09/2019 | IDR | 149.002.380 | | 10.311 | 0 | (135) | (135) | (0,01) |
| | 09/2019 | PEN | 454 | | 137 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 3.347 | COP | 10.710.571 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 659 | IDR | 9.539.025 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 680 | THB | 20.943 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 2.863 | UAH | 77.730 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 275.122 | $ | 82.505 | 0 | (777) | (777) | (0,03) |
| | 10/2019 | $ | 40.114 | MXN | 789.540 | 227 | 0 | 227 | 0,01 |
| | 10/2019 | | 3.672 | RON | 15.496 | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 32.110 | EGP | 579.682 | 1.242 | 0 | 1.242 | 0,05 |
| | 12/2019 | TRY | 44.422 | $ | 6.928 | 0 | (149) | (149) | (0,01) |
| | 03/2020 | RON | 25.177 | € | 5.071 | 0 | (125) | (125) | (0,01) |
| | 05/2020 | NGN | 2.791.998 | $ | 7.301 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 05/2020 | $ | 1.225 | ARS | 90.813 | 243 | 0 | 243 | 0,01 |
| | 04/2021 | | 1.140 | | 106.362 | 80 | 0 | 80 | 0,00 |
| DUB | 07/2019 | BRL | 10.322 | $ | 2.662 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 7.901 | ARS | 392.659 | 1.227 | 0 | 1.227 | 0,05 |
| | 07/2019 | | 14.526 | BRL | 56.078 | 106 | 0 | 106 | 0,00 |
| | 08/2019 | ARS | 640.008 | $ | 13.207 | 0 | (1.119) | (1.119) | (0,05) |
| | 09/2019 | PHP | 198.984 | | 3.816 | 0 | (55) | (55) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 83.392 | THB | 2.646.262 | 3.054 | 0 | 3.054 | 0,12 |
| | 11/2019 | | 2.746 | TRY | 18.100 | 178 | 0 | 178 | 0,01 |
| | 08/2020 | TRY | 19.318 | $ | 2.006 | 0 | (745) | (745) | (0,03) |
| FBF | 07/2019 | CLP | 8.781.099 | | 12.593 | 0 | (346) | (346) | (0,01) |
| | 12/2019 | TRY | 45.968 | | 7.159 | 0 | (164) | (164) | (0,01) |
| | 08/2020 | | 16.542 | | 1.756 | 0 | (600) | (600) | (0,02) |
| GLM | 07/2019 | ARS | 26.038 | | 571 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 07/2019 | BRL | 16.899 | | 4.359 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 07/2019 | CLP | 13.856.738 | | 20.109 | 0 | (308) | (308) | (0,01) |
| | 07/2019 | COP | 28.557.328 | | 8.963 | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| | 07/2019 | HUF | 4.158.854 | | 14.679 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | KRW | 32.226.024 | | 27.095 | 0 | (788) | (788) | (0,03) |
| | 07/2019 | MYR | 33.386 | | 8.004 | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 524.427 | | 8.105 | 0 | (194) | (194) | (0,01) |
| | 07/2019 | TWD | 797.468 | | 25.227 | 0 | (483) | (483) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 7.309 | ARS | 341.915 | 718 | 0 | 718 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 28.360 | CLP | 19.245.964 | 16 | (21) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.656 | COP | 5.523.091 | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 16.777 | IDR | 240.143.895 | 205 | 0 | 205 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 6.183 | MYR | 26.076 | 124 | 0 | 124 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 25.049 | RON | 106.225 | 519 | 0 | 519 | 0,02 |
| | 07/2019 | ZAR | 281.787 | $ | 19.782 | 0 | (186) | (186) | (0,01) |
| | 08/2019 | COP | 18.732.060 | | 5.580 | 0 | (241) | (241) | (0,01) |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | MXN | 305.416 | $ | 15.366 | $ 0 | $ (421) | $ (421) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ | 5.580 | COP | 18.732.060 | 241 | 0 | 241 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 97.762 | CZK | 2.251.858 | 3.112 | 0 | 3.112 | 0,13 |
| | 08/2019 | | 6.721 | KZT | 2.590.946 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 3.687 | MXN | 73.308 | 102 | 0 | 102 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 42.822 | MYR | 178.467 | 364 | (18) | 346 | 0,01 |
| | 09/2019 | CLP | 19.245.964 | $ | 28.363 | 15 | (18) | (3) | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR | 140.772.819 | | 9.717 | 0 | (153) | (153) | (0,01) |
| | 09/2019 | MYR | 6.864 | | 1.650 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 8.741 | MYR | 36.461 | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 22.747 | THB | 706.685 | 338 | 0 | 338 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 16.740 | TWD | 523.627 | 228 | 0 | 228 | 0,01 |
| | 10/2019 | | 8.922 | COP | 28.557.328 | 0 | (74) | (74) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 47.540 | MXN | 924.246 | 0 | (208) | (208) | (0,01) |
| | 10/2019 | | 14.630 | NGN | 5.435.045 | 227 | 0 | 227 | 0,01 |
| | 12/2019 | | 9.486 | CLP | 6.445.860 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | ARS | 1.406.325 | $ | 30.381 | 0 | (1.571) | (1.571) | (0,06) |
| | 07/2019 | BRL | 25.265 | | 6.327 | 0 | (265) | (265) | (0,01) |
| | 07/2019 | EGP | 71.467 | | 4.078 | 0 | (173) | (173) | (0,01) |
| | 07/2019 | PEN | 23.842 | | 7.148 | 0 | (99) | (99) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 8.394 | ARS | 415.821 | 1.028 | 0 | 1.028 | 0,04 |
| | 07/2019 | | 31.788 | CLP | 21.753.315 | 265 | 0 | 265 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 12.838 | NGN | 4.653.775 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 8.937 | PEN | 29.439 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 16.061 | RUB | 1.065.692 | 803 | 0 | 803 | 0,03 |
| | 08/2019 | CZK | 443.148 | $ | 19.199 | 0 | (652) | (652) | (0,03) |
| | 08/2019 | MXN | 111.394 | | 5.784 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 08/2019 | PEN | 34.637 | | 10.370 | 0 | (142) | (142) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 284 | MXN | 5.502 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | THB | 122.669 | $ | 3.958 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 117 | CNH | 814 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 10.863 | EGP | 198.820 | 815 | 0 | 815 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 3.704 | KRW | 4.359.756 | 70 | 0 | 70 | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 29.439 | $ | 8.896 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 427.275 | | 13.648 | 0 | (233) | (233) | (0,01) |
| | 11/2019 | $ | 4.885 | EGP | 88.225 | 191 | 0 | 191 | 0,01 |
| | 01/2020 | NGN | 912.662 | $ | 2.312 | 0 | (142) | (142) | (0,01) |
| | 05/2020 | | 2.228.163 | | 5.838 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 06/2020 | | 1.396.800 | | 3.638 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| IND | 07/2019 | BRL | 17.031 | | 4.390 | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 5 | € | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | THB | 200.981 | $ | 6.451 | 0 | (114) | (114) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 24.239 | MYR | 100.846 | 138 | 0 | 138 | 0,01 |
| JPM | 07/2019 | BRL | 476.435 | $ | 123.652 | 0 | (658) | (658) | (0,03) |
| | 07/2019 | CLP | 4.098.379 | | 5.769 | 0 | (268) | (268) | (0,01) |
| | 07/2019 | HUF | 11.679.979 | | 42.437 | 1.204 | 0 | 1.204 | 0,05 |
| | 07/2019 | KRW | 1.294.930 | | 1.089 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.287 | PEN | 4.302 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 46.379 | PLN | 175.517 | 704 | 0 | 704 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 13.238 | ZAR | 187.724 | 64 | 0 | 64 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 362.475 | $ | 24.891 | 0 | (795) | (795) | (0,03) |
| | 08/2019 | € | 938 | | 1.055 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 7.245 | ARS | 375.653 | 1.103 | 0 | 1.103 | 0,04 |
| | 08/2019 | | 113.191 | BRL | 436.901 | 487 | 0 | 487 | 0,02 |
| | 08/2019 | | 2.544 | MXN | 49.709 | 27 | (1) | 26 | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR | 57.586.720 | $ | 3.988 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 148 | ILS | 530 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 12.353 | KRW | 14.530.834 | 227 | 0 | 227 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 25.687 | PHP | 1.345.224 | 485 | 0 | 485 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 20.407 | THB | 628.291 | 117 | 0 | 117 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 9.886 | TRY | 76.859 | 2.812 | 0 | 2.812 | 0,11 |
| | 09/2019 | | 12.374 | TWD | 387.306 | 177 | 0 | 177 | 0,01 |
| | 10/2019 | RON | 112.275 | $ | 26.820 | 0 | (143) | (143) | (0,01) |
| | 10/2019 | $ | 112.300 | MXN | 2.200.005 | 365 | 0 | 365 | 0,01 |
| | 11/2019 | TWD | 171.231 | $ | 5.473 | 0 | (90) | (90) | 0,00 |
| | 01/2020 | NGN | 913.814 | | 2.305 | 0 | (152) | (152) | (0,01) |
| | 02/2020 | | 2.316.965 | | 6.125 | 0 | (95) | (95) | 0,00 |
| | 05/2020 | | 2.983.762 | | 7.798 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | COP | 11.562.658 | | 3.642 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 41.391 | | 7.141 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.960 | COP | 12.982.068 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 43.939 | PLN | 165.547 | 470 | 0 | 470 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 28.119 | TWD | 885.818 | 439 | 0 | 439 | 0,02 |
| | 08/2019 | MYR | 69.800 | $ | 17.141 | 258 | 0 | 258 | 0,01 |
| | 09/2019 | RUB | 1.496.963 | | 22.623 | 0 | (856) | (856) | (0,03) |
| | 09/2019 | TWD | 828.243 | | 26.371 | 0 | (468) | (468) | (0,02) |
| | 10/2019 | $ | 1.134 | RON | 4.792 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 885.818 | $ | 28.202 | 0 | (576) | (576) | (0,02) |
| | 03/2020 | RON | 25.218 | € | 5.076 | 0 | (129) | (129) | (0,01) |
| MYI | 07/2019 | ZAR | 204.500 | $ | 13.958 | 0 | (533) | (533) | (0,02) |
| RBC | 07/2019 | | 332 £ | | 422 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 709 | COP | 2.253.935 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 37.270 | PEN | 123.008 | 122 | 0 | 122 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09/2019 | COP | 2.253.935 | $ | 706 | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 123.008 | | 37.095 | 0 | (124) | (124) | (0,01) |
| RYL | 07/2019 | $ | 9.664 | ZAR | 138.601 | 157 | 0 | 157 | 0,01 |
| | 09/2019 | THB | 129.372 | $ | 4.140 | 0 | (86) | (86) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | BRL | 282.894 | | 73.651 | 0 | (160) | (160) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 16.969 | | 21.478 | 0 | (119) | (119) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 207.983 | BRL | 838.329 | 10.748 | 0 | 10.748 | 0,43 |
| | 07/2019 | | 28.358 | KRW | 33.520.953 | 646 | 0 | 646 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 13.982 | TRY | 83.026 | 365 | 0 | 365 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 73.430 | BRL | 282.894 | 177 | 0 | 177 | 0,01 |
| | 09/2019 | IDR | 977.404.607 | $ | 66.806 | 0 | (1.718) | (1.718) | (0,07) |
| | 09/2019 | KRW | 33.520.953 | | 28.430 | 0 | (590) | (590) | (0,02) |
| | 09/2019 | $ | 12.452 | THB | 382.961 | 58 | 0 | 58 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 15.711 | RON | 67.420 | 480 | 0 | 480 | 0,02 |
| SOG | 07/2019 | | 193.993 | PLN | 730.315 | 1.917 | 0 | 1.917 | 0,08 |
| | 08/2019 | | 2.956 | RUB | 195.231 | 119 | 0 | 119 | 0,01 |
| | 11/2019 | | 3.761 | TRY | 25.117 | 296 | 0 | 296 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | RUB | 255.293 | $ | 4.042 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | MYR | 23.984 | | 5.886 | 84 | 0 | 84 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ | 7.574 | CLP | 5.241.965 | 150 | 0 | 150 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 8.426 | COP | 28.557.328 | 465 | 0 | 465 | 0,02 |
| | 08/2019 | MXN | 219.384 | $ | 11.342 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | CLP | 8.323.899 | | 11.910 | 0 | (355) | (355) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 177 | | 202 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.060 | ¥ | 114.100 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.070 | ZAR | 44.935 | 114 | 0 | 114 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 53.911 | $ | 61.004 | 0 | (606) | (606) | (0,02) |
| | 08/2019 | ¥ | 114.100 | | 1.063 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR | 63.407.937 | | 4.361 | 0 | (84) | (84) | 0,00 |
| | 09/2019 | MYR | 131.705 | | 31.689 | 0 | (147) | (147) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 2.079 | IDR | 29.777.725 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 2.917 | RON | 12.441 | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| | | | | | | $ 45.522 | $ (29.624) | $ 15.898 | 0,64 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 28.336** | **1,14** |
| **Summe Anlagen** | **$ 3.178.323** | **128,41** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (703.218)** | **(28,41)** |
| **Nettovermögen** | **$ 2.475.105** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(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) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| JPMorgan Structured Products BV | 17,436 % | 16.01.2020 | 13.05.2019 | $ 13.423 | $ 13.827 | 0,34 |
| JPMorgan Structured Products BV | 17,813 | 14.11.2019 | 31.01.2019 | 7.984 | 8.477 | 0,56 |
| Malaysia Government Investment Issue | 4,837 | 15.07.2025 | 25.07.2014 | 132 | 103 | 0,00 |
| QNB Finance Ltd. | 7,900 | 05.07.2024 | 26.06.2019 | 12.585 | 12.658 | 0,51 |
| | | | | $ 34.124 | $ 35.065 | 1,41 |

**(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 420.549 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 280 und Barmittel in Höhe von USD 2.452 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 22.231 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 7.180 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 4.884 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (4.985) | $ 4.884 | $ 4.885 | 0,20 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (4.985)** | **$ 4.884** | **$ 4.885** | **0,20** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 23.312 | $ 3.042.727 | $ 65.955 | $ 3.131.994 |
| Finanzderivate[3] | 2.213 | 44.116 | 0 | 46.329 |
| **Summen** | **$ 25.525** | **$ 3.086.843** | **$ 65.955** | **$ 3.178.323** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 221.056 | $ 2.260.400 | $ 24.807 | $ 2.506.263 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 7.304 | 0 | 7.304 |
| Finanzderivate[3] | 1.940 | 1.713 | 0 | 3.653 |
| **Summen** | **$ 222.996** | **$ 2.269.417** | **$ 24.807** | **$ 2.517.220** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | 2,850 % | 14.06.2019 | 16.07.2019 | $ (4.806) | $ (4.812) | (0,19) |
| BPS | 1,780 | 06.06.2019 | 18.07.2019 | PLN (192.881) | (51.784) | (2,09) |
| | 1,830 | 28.05.2019 | 18.07.2019 | (137.579) | (36.955) | (1,49) |
| | 2,650 | 07.06.2019 | 09.07.2019 | $ (2.438) | (2.442) | (0,10) |
| | 2,650 | 17.06.2019 | 18.07.2019 | (34.730) | (34.766) | (1,40) |
| | 2,690 | 17.06.2019 | 18.07.2019 | (7.424) | (7.432) | (0,30) |
| | 7,580 | 28.06.2019 | 18.07.2019 | ZAR (183.872) | (13.048) | (0,53) |
| JML | 2,000 | 19.06.2019 | 16.07.2019 | $ (2.226) | (2.228) | (0,09) |
| | 2,750 | 13.06.2019 | 16.07.2019 | (5.149) | (5.156) | (0,21) |
| | 2,800 | 21.06.2019 | 16.07.2019 | (8.189) | (8.196) | (0,33) |
| | 2,800 | 24.06.2019 | 24.07.2019 | (5.128) | (5.131) | (0,21) |
| | 2,850 | 26.06.2019 | 05.07.2019 | (68.393) | (68.421) | (2,76) |
| MBC | 1,700 | 04.06.2019 | 18.07.2019 | PLN (185.239) | (49.734) | (2,01) |
| | 1,700 | 14.06.2019 | 18.07.2019 | (194.056) | (52.102) | (2,11) |
| | 2,850 | 26.06.2019 | 26.07.2019 | (46.972) | (46.990) | (1,90) |
| | 8,750 | 25.06.2019 | 22.07.2019 | MXN (549.600) | (28.649) | (1,16) |
| UBS | 2,700 | 17.06.2019 | 14.06.2021 | $ (8.124) | (8.133) | (0,33) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (425.979)** | **(17,21)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/ verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 12 | $ 0 | $ 12 |
| BOA | 495 | (340) | 155 |
| BPS | (2.486) | 3.520 | 1.034 |
| BRC | (671) | 290 | (381) |
| BSH | 715 | (630) | 85 |
| BSS | (83) | 0 | (83) |
| CBK | 22 | (360) | (338) |
| DUB | 4.332 | (6.330) | (1998) |
| FBF | (1.196) | 1.160 | (36) |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| GLM | $ 10.220 | $ (10.070) | $ 150 |
| GST | (9) | 0 | (9) |
| HUS | 2.561 | (3.210) | (649) |
| IND | (30) | 20 | (10) |
| JPM | 3.786 | (4.240) | (454) |
| MSB | (733) | 0 | (733) |
| MYC | (97) | 66 | (31) |
| MYI | (533) | 1.110 | 577 |
| NGF | 37 | 0 | 37 |
| RBC | (2) | 0 | (2) |
| RYL | 71 | (230) | (159) |
| SCX | 9.887 | (8.160) | 1.727 |
| SOG | 2.332 | (1.860) | 472 |
| SSB | 86 | 0 | 86 |
| TOR | 618 | (420) | 198 |
| UAG | (998) | 990 | (8) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 89,22 | 67,42 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 37,12 | 42,27 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,20 | 0,17 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,09 | 0,08 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,64 | 0,11 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,14 | (0,03) |
| Einlagenzertifikate | 0,00 | 0,32 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (17,21) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 1,60 | 1,58 |
| Brasilien | 2,61 | 1,53 |
| Cayman-Inseln | 2,32 | 1,46 |
| Chile | 1,80 | 1,37 |
| Kolumbien | 7,32 | 2,37 |
| Tschechische Republik | 1,19 | 1,14 |
| Dominikanische Republik | 1,14 | 0,15 |
| Frankreich | 1,11 | 1,06 |
| Deutschland | 3,18 | 2,92 |
| Hongkong | 0,15 | 0,00 |
| Ungarn | 8,53 | 3,40 |
| Indien | 0,94 | 0,88 |
| Indonesien | 0,79 | 0,74 |
| Irland | 1,94 | 1,53 |
| Japan | 1,61 | 2,21 |
| Kasachstan | 0,24 | 0,23 |
| Luxemburg | 0,24 | 1,11 |
| Malaysia | 5,21 | 5,32 |
| Mexiko | 2,60 | 2,58 |
| Niederlande | 0,31 | 0,01 |
| Nigeria | 0,12 | 0,00 |
| Peru | 11,91 | 6,80 |
| Philippinen | 0,43 | 0,44 |
| Polen | 7,93 | 8,19 |
| Katar | 1,87 | 1,09 |
| Rumänien | 1,05 | 1,03 |
| Russland | 8,94 | 5,29 |
| Südafrika | 10,39 | 9,25 |
| Südkorea | 0,92 | 0,56 |
| Spanien | 0,10 | 0,11 |
| Sri Lanka | 0,00 | 0,43 |
| Supranational | 3,32 | 3,79 |
| Thailand | 2,72 | 2,55 |
| Türkei | 2,60 | 3,92 |
| Ukraine | 0,65 | 0,42 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 1,39 | 0,50 |
| Großbritannien | 1,93 | 1,95 |
| Vereinigte Staaten | 17,44 | 15,42 |
| Uruguay | 0,29 | 0,34 |
| Kurzfristige Instrumente | 7,58 | 6,88 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,13 | 9,31 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,09 | 0,08 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,04 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,59 | 0,11 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | (0,03) | (0,03) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,03) | 0,01 |
| Cross-Currency Swaps | (0,02) | 0,01 |
| Zinsswaps | 0,58 | 0,23 |
| Devisenterminkontrakte | 0,64 | (0,25) |
| Einlagenzertifikate | 0,00 | 0,32 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (28,41) | (10,34) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ALBANIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Albania Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 09.10.2025 | € | 3.300 | $ 3.991 | 0,11 |
| **ANGOLA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Angolan Government International Bond** | | | | |
| 9,375 % fällig am 08.05.2048 | $ | 3.400 | 3.757 | 0,10 |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco de Galicia y Buenos Aires S.A.** | | | | |
| 25,980 % fällig am 26.04.2020 | ARS | 100.000 | 1.671 | 0,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentinien Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | € | 9.600 | 8.563 | 0,23 |
| 3,380 % fällig am 31.12.2038 | | 16.750 | 10.904 | 0,29 |
| 3,750 % fällig am 31.12.2038 | $ | 38.100 | 22.384 | 0,60 |
| 4,625 % fällig am 11.01.2023 | | 9.600 | 7.704 | 0,20 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2027 | € | 2.200 | 1.838 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | | 4.800 | 3.995 | 0,11 |
| 5,625 % fällig am 26.01.2022 | $ | 8.000 | 6.760 | 0,18 |
| 5,875 % fällig am 11.01.2028 | | 14.300 | 10.913 | 0,29 |
| 6,625 % fällig am 06.07.2028 | | 2.100 | 1.626 | 0,04 |
| 6,875 % fällig am 26.01.2027 | | 8.250 | 6.638 | 0,18 |
| 6,875 % fällig am 11.01.2048 | | 26.800 | 19.933 | 0,53 |
| 7,125 % fällig am 06.07.2036 | | 39.600 | 30.735 | 0,82 |
| 7,125 % fällig am 28.06.2117 | | 2.900 | 2.175 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 22.04.2026 | | 6.342 | 5.372 | 0,14 |
| 7,625 % fällig am 22.04.2046 | | 5.000 | 3.976 | 0,11 |
| 7,820 % fällig am 31.12.2033 | € | 10.321 | 9.827 | 0,26 |
| 8,280 % fällig am 31.12.2033 | $ | 8.272 | 6.938 | 0,18 |
| 8,750 % fällig am 07.05.2024 | | 417 | 299 | 0,01 |
| **Provincia de Cordoba** | | | | |
| 7,125 % fällig am 10.06.2021 | | 5.800 | 5.075 | 0,13 |
| **Provincia de la Rioja** | | | | |
| 9,750 % fällig am 24.02.2025 | | 2.400 | 1.860 | 0,05 |
| **Provincia de Neuquen** | | | | |
| 7,500 % fällig am 27.04.2025 | | 2.140 | 1.808 | 0,05 |
| | | | 169.323 | 4,51 |
| Summe Argentinien | | | 170.994 | 4,56 |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Sappi Papier Holding GmbH** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2026 | € | 3.800 | 4.458 | 0,12 |
| **ASERBAIDSCHAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Southern Gas Corridor CJSC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 24.03.2026 | $ | 43.100 | 50.080 | 1,33 |
| **State Oil Co. of the Aserbaidschan Republic** | | | | |
| 4,750 % fällig am 13.03.2023 | | 1.000 | 1.043 | 0,03 |
| | | | 51.123 | 1,36 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Aserbaidschan Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 18.03.2024 | | 4.400 | 4.633 | 0,13 |
| Summe Aserbaidschan | | | 55.756 | 1,49 |
| **BAHAMAS** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bahamas Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 21.11.2028 | | 11.750 | 12.732 | 0,34 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Brasilien Minas SPE via State of Minas Gerais** | | | | |
| 5,333 % fällig am 15.02.2028 | | 54.891 | 56.812 | 1,51 |
| **Centrais Eletricas Brasileiras S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 27.10.2021 | $ | 600 | $ 629 | 0,02 |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.07.2019 (d)(f) | | 14.563 | 161 | 0,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.02.2029 | | 6.000 | 6.269 | 0,17 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | | 7.900 | 8.209 | 0,22 |
| 6,875 % fällig am 20.01.2040 | | 2.350 | 2.557 | 0,07 |
| 7,250 % fällig am 17.03.2044 | | 2.000 | 2.242 | 0,06 |
| 7,375 % fällig am 17.01.2027 | | 4.200 | 4.813 | 0,13 |
| 8,750 % fällig am 23.05.2026 | | 2.000 | 2.474 | 0,07 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.08.2026 | | 7.000 | 7.987 | 0,21 |
| 6,875 % fällig am 21.11.2036 | | 5.280 | 6.369 | 0,17 |
| 6,875 % fällig am 10.11.2039 | | 2.200 | 2.651 | 0,07 |
| | | | 101.173 | 2,70 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Brasilien Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 27.01.2045 | | 17.520 | 17.373 | 0,46 |
| 5,625 % fällig am 21.02.2047 | | 9.700 | 10.363 | 0,28 |
| | | | 27.736 | 0,74 |
| Summe Brasilien | | | 128.909 | 3,44 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.** | | | | |
| 3,512 % fällig am 20.04.2027 | | 1.199 | 1.196 | 0,03 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.06.2034 (d) | | 14.500 | 9.824 | 0,26 |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 7.700 | 7.443 | 0,20 |
| 8,750 % fällig am 28.06.2025 | | 1.000 | 889 | 0,02 |
| 9,500 % fällig am 11.04.2022 | | 3.000 | 2.981 | 0,08 |
| **Fab Sukuk Co. Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 05.03.2023 | | 2.700 | 2.774 | 0,07 |
| **Interoceanica Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.05.2030 (d) | | 8.900 | 6.865 | 0,18 |
| **KSA Sukuk Ltd.** | | | | |
| 4,303 % fällig am 19.01.2029 | | 3.900 | 4.187 | 0,11 |
| **Lima Metro Line Finance Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | | 3.800 | 4.051 | 0,11 |
| **MAF Sukuk Ltd.** | | | | |
| 4,638 % fällig am 14.05.2029 | | 18.400 | 19.159 | 0,51 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | | 9.419 | 9.371 | 0,25 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 (b) | | 11.434 | 7.118 | 0,19 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 | | 7.757 | 7.486 | 0,20 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | | 8.400 | 8.571 | 0,23 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 6.500 | 7.076 | 0,19 |
| **SPARC EM SPC Panama Metro Line SP** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.12.2022 (d) | | 7.431 | 7.060 | 0,19 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 | | 7.000 | 7.004 | 0,19 |
| 8,375 % fällig am 15.01.2021 | | 7.000 | 7.249 | 0,19 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,975 % fällig am 11.04.2029 | | 14.900 | 15.588 | 0,42 |
| | | | 134.696 | 3,59 |
| Summe Cayman Inseln | | | 135.892 | 3,62 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Corp. Nacional del Cobre de Chile** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.08.2027 | | 5.900 | 6.123 | 0,16 |
| 4,250 % fällig am 17.07.2042 | | 12.500 | 13.102 | 0,35 |
| 4,500 % fällig am 16.09.2025 | | 7.200 | 7.827 | 0,21 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2047 | | 1.200 | 1.299 | 0,03 |
| 4,875 % fällig am 04.11.2044 | | 5.900 | 6.739 | 0,18 |
| 6,150 % fällig am 24.10.2036 | $ | 1.000 | $ 1.311 | 0,04 |
| **Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.10.2024 | | 12.200 | 12.898 | 0,34 |
| **GNL Quintero S.A.** | | | | |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029 | | 11.000 | 11.688 | 0,31 |
| **Latam Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.08.2029 | | 12.373 | 12.555 | 0,34 |
| 4,500 % fällig am 15.08.2025 | | 265 | 264 | 0,01 |
| **Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.05.2029 | | 8.600 | 9.088 | 0,24 |
| Summe Chile | | | 82.894 | 2,21 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **China Construction Bank Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 13.05.2025 (h) | | 200 | 201 | 0,01 |
| **CNAC HK Finbridge Co. Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 19.07.2022 | | 4.700 | 4.733 | 0,13 |
| 4,125 % fällig am 19.07.2027 | | 3.000 | 3.088 | 0,08 |
| 4,875 % fällig am 14.03.2025 | | 10.000 | 10.773 | 0,29 |
| **Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 27.07.2021 | | 2.400 | 2.411 | 0,06 |
| 4,200 % fällig am 27.07.2026 | | 800 | 835 | 0,02 |
| **Rongshi International Finance Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 04.05.2022 | | 4.500 | 4.525 | 0,12 |
| 3,625 % fällig am 04.05.2027 | | 2.400 | 2.477 | 0,07 |
| **SF Holding Investment Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 26.07.2023 | | 4.800 | 5.005 | 0,13 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 13.09.2022 | | 500 | 498 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 03.05.2026 | | 4.000 | 4.104 | 0,11 |
| 4,375 % fällig am 17.10.2023 | | 11.700 | 12.441 | 0,33 |
| 4,375 % fällig am 10.04.2024 | | 2.800 | 2.997 | 0,08 |
| 4,875 % fällig am 17.05.2042 | | 5.200 | 6.054 | 0,16 |
| **State Grid Overseas Investment Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 07.05.2024 | | 200 | 213 | 0,01 |
| **Three Gorges Finance Cayman Islands Ltd.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 02.06.2026 | | 4.600 | 4.634 | 0,12 |
| | | | 64.989 | 1,73 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of China** | | | | |
| 3,625 % fällig am 31.07.2024 | | 200 | 209 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 28.11.2047 | | 7.100 | 7.651 | 0,20 |
| | | | 7.860 | 0,21 |
| Summe China | | | 72.849 | 1,94 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ecopetrol S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 26.06.2026 | | 2.100 | 2.318 | 0,06 |
| 5,875 % fällig am 28.05.2045 | | 9.000 | 9.987 | 0,27 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2043 | | 2.800 | 3.602 | 0,09 |
| | | | 15.907 | 0,42 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kolumbien Government International Bond** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.03.2023 | | 1.100 | 1.096 | 0,03 |
| 3,875 % fällig am 25.04.2027 | | 3.900 | 4.072 | 0,11 |
| 4,500 % fällig am 15.03.2029 | | 5.900 | 6.452 | 0,17 |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045 | | 3.600 | 3.981 | 0,11 |
| 5,200 % fällig am 15.05.2049 | | 14.000 | 15.901 | 0,42 |
| 5,625 % fällig am 26.02.2044 | | 4.500 | 5.335 | 0,14 |
| 6,125 % fällig am 18.01.2041 | | 6.195 | 7.682 | 0,20 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2037 | | 6.245 | 8.517 | 0,23 |
| 8,125 % fällig am 21.05.2024 | | 500 | 617 | 0,02 |
| | | | 53.653 | 1,43 |
| Summe Kolumbien | | | 69.560 | 1,85 |
| **COSTA RICA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Instituto Costarricense de Electricidad** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2043 | | 2.200 | 1.848 | 0,05 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Costa Rica Government International Bond** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 30.04.2025 | $ | 2.000 | $ | 1.923 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 30.04.2043 | | 10.900 | | 9.469 | 0,25 |
| 7,000 % fällig am 04.04.2044 | | 3.300 | | 3.288 | 0,09 |
| | | | | 14.680 | 0,39 |
| Summe Costa Rica | | | | 16.528 | 0,44 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Dominican Republic International Bond** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 27.01.2025 | | 14.400 | | 15.354 | 0,41 |
| 5,950 % fällig am 25.01.2027 | | 16.000 | | 17.300 | 0,46 |
| 6,000 % fällig am 19.07.2028 | | 25.400 | | 27.496 | 0,73 |
| 6,400 % fällig am 05.06.2049 | | 16.000 | | 16.780 | 0,45 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2048 | | 6.950 | | 7.367 | 0,20 |
| 6,850 % fällig am 27.01.2045 | | 8.900 | | 9.761 | 0,26 |
| 6,875 % fällig am 29.01.2026 | | 4.100 | | 4.643 | 0,12 |
| 7,500 % fällig am 06.05.2021 | | 5.533 | | 5.838 | 0,16 |
| Summe Dominikanische Republik | | | | 104.539 | 2,79 |
| **ECUADOR** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ecuador Government International Bond** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 23.01.2028 | | 15.150 | | 15.037 | 0,40 |
| 9,625 % fällig am 02.06.2027 | | 860 | | 930 | 0,02 |
| 9,650 % fällig am 13.12.2026 | | 2.000 | | 2.170 | 0,06 |
| 10,750 % fällig am 31.01.2029 | | 26.400 | | 29.865 | 0,80 |
| Summe Ecuador | | | | 48.002 | 1,28 |
| **ÄGYPTEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ägypten Government International Bond** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 11.04.2025 | € | 4.900 | | 5.713 | 0,15 |
| 4,750 % fällig am 16.04.2026 | | 2.800 | | 3.211 | 0,09 |
| 5,577 % fällig am 21.02.2023 | $ | 3.400 | | 3.462 | 0,09 |
| 5,625 % fällig am 16.04.2030 | € | 3.000 | | 3.350 | 0,09 |
| 6,125 % fällig am 31.01.2022 | $ | 11.100 | | 11.468 | 0,31 |
| 6,375 % fällig am 11.04.2031 | € | 4.800 | | 5.573 | 0,15 |
| 7,500 % fällig am 31.01.2027 | $ | 11.600 | | 12.402 | 0,33 |
| 7,600 % fällig am 01.03.2029 | | 24.000 | | 25.375 | 0,68 |
| 7,903 % fällig am 21.02.2048 | | 2.600 | | 2.642 | 0,07 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2047 | | 12.200 | | 12.963 | 0,34 |
| Summe Ägypten | | | | 86.159 | 2,30 |
| **EL SALVADOR** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **El Salvador Government International Bond** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.01.2025 | | 2.000 | | 2.000 | 0,05 |
| 6,375 % fällig am 18.01.2027 | | 4.100 | | 4.105 | 0,11 |
| 7,625 % fällig am 21.09.2034 | | 3.800 | | 3.948 | 0,11 |
| 8,250 % fällig am 10.04.2032 | | 290 | | 320 | 0,01 |
| Summe El Salvador | | | | 10.373 | 0,28 |
| **GABUN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Gabun Government International Bond** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 12.12.2024 | | 2.041 | | 2.027 | 0,05 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 6.300 | | 7.236 | 0,19 |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | | 4.500 | | 5.203 | 0,14 |
| 3,700 % fällig am 30.05.2024 | $ | 4.222 | | 4.107 | 0,11 |
| 3,715 % fällig am 16.11.2022 | | 10.800 | | 10.440 | 0,28 |
| 3,950 % fällig am 27.02.2023 | | 6.769 | | 6.797 | 0,18 |
| 5,000 % fällig am 14.02.2022 | | 2.500 | | 2.578 | 0,07 |
| Summe Deutschland | | | | 36.361 | 0,97 |
| **GHANA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ghana Government International Bond** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 07.08.2023 | | 7.730 | | 8.402 | 0,23 |
| 7,875 % fällig am 26.03.2027 | | 10.000 | | 10.551 | 0,28 |
| 8,125 % fällig am 26.03.2032 | $ | 15.600 | $ | 15.889 | 0,42 |
| 8,950 % fällig am 26.03.2051 | | 18.100 | | 18.788 | 0,50 |
| Summe Ghana | | | | 53.630 | 1,43 |
| **GUATEMALA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Guatemala Government International Bond** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 05.06.2027 | | 10.800 | | 10.814 | 0,29 |
| 4,500 % fällig am 03.05.2026 | | 2.600 | | 2.633 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 13.02.2028 | | 6.320 | | 6.533 | 0,17 |
| 4,900 % fällig am 01.06.2030 | | 5.000 | | 5.150 | 0,14 |
| 5,750 % fällig am 06.06.2022 | | 23.270 | | 24.823 | 0,66 |
| 6,125 % fällig am 01.06.2050 | | 8.600 | | 9.041 | 0,24 |
| 8,125 % fällig am 06.10.2034 | | 1.838 | | 2.378 | 0,06 |
| Summe Guatemala | | | | 61.372 | 1,63 |
| **HONGKONG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Bright Food Singapur Holdings Pte Ltd.** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 19.06.2024 | € | 7.400 | | 8.525 | 0,23 |
| **CNOOC Nexen Finance ULC** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.04.2024 | $ | 16.700 | | 17.752 | 0,47 |
| **Huaneng Hong Kong Capital Ltd.** | | | | | |
| 3,600 % fällig am 30.10.2022 (f) | | 5.900 | | 5.785 | 0,15 |
| Summe Hongkong | | | | 32.062 | 0,85 |
| **INDIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 03.07.2029 (a) | | 8.000 | | 8.128 | 0,22 |
| **Delhi International Airport Ltd.** | | | | | |
| 6,450 % fällig am 04.06.2029 | | 2.100 | | 2.217 | 0,06 |
| **NTPC Ltd.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 03.04.2024 | | 2.000 | | 2.036 | 0,05 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | | |
| 5,700 % fällig am 27.02.2022 | | 5.000 | | 5.076 | 0,13 |
| **State Bank of Indien** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.01.2022 | | 3.300 | | 3.378 | 0,09 |
| | | | | 20.835 | 0,55 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Export-Import Bank of Indien** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 05.08.2026 | | 1.100 | | 1.103 | 0,03 |
| 3,875 % fällig am 12.03.2024 | | 13.000 | | 13.404 | 0,36 |
| | | | | 14.507 | 0,39 |
| Summe Indien | | | | 35.342 | 0,94 |
| **INDONESIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Indonesien Asahan Aluminium Persero PT** | | | | | |
| 5,230 % fällig am 15.11.2021 | | 3.200 | | 3.375 | 0,09 |
| 5,710 % fällig am 15.11.2023 | | 14.600 | | 16.032 | 0,43 |
| 6,530 % fällig am 15.11.2028 | | 11.200 | | 13.247 | 0,35 |
| **Pelabuhan Indonesien Persero PT** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 02.05.2023 | | 22.300 | | 23.331 | 0,62 |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 500 | | 536 | 0,01 |
| **Pelabuhan Indonesien PT** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.05.2025 | | 8.200 | | 8.528 | 0,23 |
| 5,375 % fällig am 05.05.2045 | | 3.693 | | 3.873 | 0,10 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 03.05.2022 | | 7.333 | | 7.740 | 0,21 |
| 5,625 % fällig am 20.05.2043 | | 3.000 | | 3.312 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 03.05.2042 | | 12.200 | | 14.064 | 0,38 |
| 6,450 % fällig am 30.05.2044 | | 20.500 | | 25.189 | 0,67 |
| 6,500 % fällig am 07.11.2048 | | 8.300 | | 10.281 | 0,27 |
| **Perusahaan Listrik Negara PT** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.05.2027 | | 2.300 | | 2.353 | 0,06 |
| 5,375 % fällig am 25.01.2029 (j) | | 7.000 | | 7.748 | 0,21 |
| 5,450 % fällig am 21.05.2028 | | 3.000 | | 3.330 | 0,09 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2049 | | 10.000 | | 11.968 | 0,32 |
| | | | | 154.907 | 4,13 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Indonesien Government International Bond** | | | | | |
| 4,100 % fällig am 24.04.2028 | | 16.200 | | 17.128 | 0,46 |
| 4,450 % fällig am 11.02.2024 | | 10.000 | | 10.634 | 0,28 |
| 5,125 % fällig am 15.01.2045 | $ | 9.450 | $ | 10.665 | 0,28 |
| 5,375 % fällig am 17.10.2023 | | 2.800 | | 3.077 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 17.02.2037 | | 7.480 | | 9.747 | 0,26 |
| 6,750 % fällig am 15.01.2044 | | 28.950 | | 39.642 | 1,06 |
| 8,500 % fällig am 12.10.2035 | | 8.790 | | 13.260 | 0,35 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesien** | | | | | |
| 4,400 % fällig am 01.03.2028 | | 5.000 | | 5.332 | 0,14 |
| 4,450 % fällig am 20.02.2029 | | 13.800 | | 14.800 | 0,40 |
| 4,550 % fällig am 29.03.2026 | | 2.000 | | 2.141 | 0,06 |
| | | | | 126.426 | 3,37 |
| Summe Indonesien | | | | 281.333 | 7,50 |
| **IRLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 18.02.2025 (h) | | 1.400 | | 1.459 | 0,04 |
| **GE Capital European Funding Unlimited Co.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.05.2021 | € | 300 | | 341 | 0,01 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 13.09.2023 | £ | 100 | | 138 | 0,00 |
| **Rosneft Oil Co Via Rosneft International Finance DAC** | | | | | |
| 4,199 % fällig am 06.03.2022 | $ | 200 | | 203 | 0,01 |
| **Russlandn Railways via RZD Capital PLC** | | | | | |
| 7,487 % fällig am 25.03.2031 | £ | 5.000 | | 7.900 | 0,21 |
| **Vnesheconombank Via VEB Finance PLC** | | | | | |
| 5,942 % fällig am 21.11.2023 (j) | $ | 5.100 | | 5.417 | 0,14 |
| | | | | 15.458 | 0,41 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)** | | 1.943.234 | | 20.599 | 0,55 |
| **PIMCO Specialty Funds Irland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)** | | 748.199 | | 8.709 | 0,23 |
| | | | | 29.308 | 0,78 |
| Summe Irland | | | | 44.766 | 1,19 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ISRAEL** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Delek & Avner Tamar Bond Ltd.** | | | | | |
| 5,082 % fällig am 30.12.2023 | $ | 900 | | 927 | 0,03 |
| 5,412 % fällig am 30.12.2025 | | 6.160 | | 6.394 | 0,17 |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.08.2028 | | 8.400 | | 8.772 | 0,23 |
| | | | | 16.093 | 0,43 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Israel Government International Bond** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 17.01.2048 | | 6.100 | | 6.693 | 0,17 |
| 4,500 % fällig am 30.01.2043 | | 200 | | 230 | 0,01 |
| | | | | 6.923 | 0,18 |
| Summe Israel | | | | 23.016 | 0,61 |
| **ELFENBEINKÜSTE** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ivory Coast Government International Bond** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.06.2025 | € | 16.500 | | 19.655 | 0,52 |
| 5,250 % fällig am 22.03.2030 | | 6.650 | | 7.424 | 0,20 |
| 5,750 % fällig am 31.12.2032 | $ | 177 | | 173 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 15.06.2033 | | 5.700 | | 5.322 | 0,14 |
| 6,375 % fällig am 03.03.2028 | | 7.300 | | 7.244 | 0,19 |
| Summe Elfenbeinküste | | | | 39.818 | 1,06 |
| **JORDANIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Jordanien Government International Bond** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.01.2027 | | 5.500 | | 5.583 | 0,15 |
| 6,125 % fällig am 29.01.2026 | | 3.300 | | 3.430 | 0,09 |
| 7,375 % fällig am 10.10.2047 | | 400 | | 414 | 0,01 |
| Summe Jordanienien | | | | 9.427 | 0,25 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **KazMunayGas National Co. JSC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.04.2025 | $ | 6.300 | $ 6.726 | 0,18 |
| 4,750 % fällig am 19.04.2027 | | 6.300 | 6.766 | 0,18 |
| | | | 13.492 | 0,36 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kasachstan Government International Bond** | | | | |
| 1,550 % fällig am 09.11.2023 | € | 2.900 | 3.476 | 0,09 |
| 2,375 % fällig am 09.11.2028 | | 2.200 | 2.720 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 14.10.2044 | $ | 6.800 | 7.847 | 0,21 |
| 6,500 % fällig am 21.07.2045 | | 5.100 | 7.073 | 0,19 |
| | | | 21.116 | 0,56 |
| Summe Kasachstan | | | 34.608 | 0,92 |
| **KENIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kenia Government International Bond** | | | | |
| 6,875 % fällig am 24.06.2024 | | 8.850 | 9.441 | 0,25 |
| 7,250 % fällig am 28.02.2028 | | 3.900 | 4.052 | 0,11 |
| 8,000 % fällig am 22.05.2032 | | 5.900 | 6.246 | 0,17 |
| 8,250 % fällig am 28.02.2048 | | 1.500 | 1.565 | 0,04 |
| Summe Kenia | | | 21.304 | 0,57 |
| **KUWAIT** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kuwait International Government Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 20.03.2027 | | 5.000 | 5.331 | 0,14 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Sovereign Credit Opportunities S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.09.2019 | € | 828 | 950 | 0,02 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(b) | $ | 8.180 | 3.927 | 0,10 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (9,000 % bar und 0,500 % PIK)** | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(b) | | 483 | 232 | 0,01 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.09.2022 | | 13.000 | 13.279 | 0,35 |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | | 17.500 | 19.041 | 0,51 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | € | 15.000 | 18.326 | 0,49 |
| 4,950 % fällig am 19.07.2022 | $ | 6.400 | 6.723 | 0,18 |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 17.400 | 18.574 | 0,49 |
| 6,510 % fällig am 07.03.2022 | | 6.320 | 6.838 | 0,18 |
| 8,625 % fällig am 28.04.2034 | | 1.300 | 1.776 | 0,05 |
| **Sberbank of Russland Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 16.065 | 17.084 | 0,46 |
| | | | 105.800 | 2,82 |
| Summe Luxemburg | | | 106.750 | 2,84 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petronas Capital Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 18.03.2025 | | 900 | 941 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 18.03.2045 | | 2.000 | 2.336 | 0,06 |
| Summe Malaysia | | | 3.277 | 0,09 |
| **MARSHALLINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | | |
| 6,267 % fällig am 31.12.2033 | | 79 | 91 | 0,00 |
| **MEXIKO** | | | | |
| | | **AKTIEN** | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. (c)** | | 39.443 | 0 | 0,00 |
| **Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (c)** | | 52.446 | 3 | 0,00 |
| | | | 3 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **America Movil S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 6,450 % fällig am 05.12.2022 | $ | 88.000 | $ 4.313 | 0,11 |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 27.06.2029 (f)(h) | | 4.900 | 4.959 | 0,13 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | | 590 | 644 | 0,02 |
| **Comision Federal de Electricidad** | | | | |
| 4,750 % fällig am 23.02.2027 | | 4.500 | 4.637 | 0,12 |
| 5,750 % fällig am 14.02.2042 | | 400 | 423 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 16.06.2045 | | 2.400 | 2.661 | 0,07 |
| **Corp. GEO S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 8,875 % fällig am 25.09.2014 ^ | | 13.920 | 0 | 0,00 |
| 9,250 % fällig am 30.06.2020 ^ | | 1.000 | 0 | 0,00 |
| **Fomento Economico Mexicano S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 10.05.2023 | | 2.600 | 2.596 | 0,07 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.01.2025 | | 1.000 | 927 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 27.06.2044 | | 20.100 | 16.145 | 0,43 |
| 5,625 % fällig am 23.01.2046 | | 18.700 | 15.156 | 0,40 |
| 6,350 % fällig am 12.02.2048 | | 42.674 | 36.796 | 0,98 |
| 6,375 % fällig am 23.01.2045 | | 13.700 | 11.833 | 0,32 |
| 6,500 % fällig am 13.03.2027 | | 6.300 | 6.236 | 0,17 |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041 | | 24.660 | 21.935 | 0,58 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 7.300 | 6.780 | 0,18 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2038 | | 500 | 448 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 12.000 | 10.716 | 0,29 |
| 6,875 % fällig am 04.08.2026 | | 2.200 | 2.233 | 0,06 |
| **Trust F** | | | | |
| 4,869 % fällig am 15.01.2030 | | 5.800 | 5.849 | 0,16 |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 5.700 | 5.856 | 0,16 |
| | | | 161.143 | 4,29 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexiko Government International Bond** | | | | |
| 3,600 % fällig am 30.01.2025 | | 2.000 | 2.052 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 13.370 | 15.495 | 0,41 |
| 4,150 % fällig am 28.03.2027 | $ | 2.500 | 2.624 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 22.04.2029 | | 8.300 | 8.910 | 0,24 |
| 4,600 % fällig am 23.01.2046 | | 17.231 | 17.671 | 0,47 |
| 4,600 % fällig am 10.02.2048 | | 13.500 | 13.939 | 0,37 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2044 | | 410 | 429 | 0,01 |
| 5,550 % fällig am 21.01.2045 | | 12.990 | 15.166 | 0,41 |
| 5,750 % fällig am 12.10.2110 | | 29.750 | 32.577 | 0,87 |
| 6,050 % fällig am 11.01.2040 | | 4.700 | 5.621 | 0,15 |
| 6,750 % fällig am 27.09.2034 | | 1.000 | 1.277 | 0,03 |
| | | | 115.761 | 3,09 |
| Summe Mexiko | | | 276.907 | 7,38 |
| **MONGOLEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mongolei Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 05.12.2022 | | 9.565 | 9.667 | 0,26 |
| 5,625 % fällig am 01.05.2023 | | 7.100 | 7.237 | 0,19 |
| Summe Mongolei | | | 16.904 | 0,45 |
| **MAROKKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **OCP S.A.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 25.04.2024 | | 3.000 | 3.237 | 0,09 |
| **NAMIBIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Namibia Government International Bond** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.10.2025 | | 1.800 | 1.813 | 0,05 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Penta CLO BV** | | | | |
| 0,790 % fällig am 04.08.2028 | € | 250 | 285 | 0,01 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CIMPOR Financial Operations BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 17.07.2024 | $ | 4.950 | 4.362 | 0,12 |
| **Kasachstan Temir Zholy Finance BV** | | | | |
| 6,950 % fällig am 10.07.2042 | | 5.960 | 7.423 | 0,20 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Metinvest BV** | | | | |
| 7,750 % fällig am 23.04.2023 | $ | 3.399 | $ 3.523 | 0,09 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | | 400 | 416 | 0,01 |
| | | | 15.724 | 0,42 |
| Summe Niederlande | | | 16.009 | 0,43 |
| **NIGERIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Nigeria Government International Bond** | | | | |
| 5,625 % fällig am 27.06.2022 | | 6.700 | 6.938 | 0,18 |
| 6,375 % fällig am 12.07.2023 | | 200 | 212 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 28.11.2027 | | 12.400 | 12.446 | 0,33 |
| 7,143 % fällig am 23.02.2030 | | 18.500 | 18.754 | 0,50 |
| 7,625 % fällig am 21.11.2025 | | 6.000 | 6.566 | 0,17 |
| 7,625 % fällig am 28.11.2047 | | 1.900 | 1.899 | 0,05 |
| 7,696 % fällig am 23.02.2038 | | 8.400 | 8.544 | 0,23 |
| 7,875 % fällig am 16.02.2032 | | 3.350 | 3.511 | 0,09 |
| 8,747 % fällig am 21.01.2031 | | 7.950 | 8.871 | 0,24 |
| 9,248 % fällig am 21.01.2049 | | 6.600 | 7.488 | 0,20 |
| Summe Nigeria | | | 75.229 | 2,00 |
| **OMAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Oman Sovereign Sukuk SAOC** | | | | |
| 5,932 % fällig am 31.10.2025 | | 12.400 | 12.563 | 0,33 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Oman Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.06.2026 | | 2.000 | 1.854 | 0,05 |
| 5,375 % fällig am 08.03.2027 | | 9.300 | 8.755 | 0,23 |
| 5,625 % fällig am 17.01.2028 | | 20.400 | 19.396 | 0,52 |
| 6,500 % fällig am 08.03.2047 | | 1.600 | 1.387 | 0,04 |
| | | | 31.392 | 0,84 |
| Summe Oman | | | 43.955 | 1,17 |
| **PAKISTAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 13.10.2021 | | 2.800 | 2.831 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 05.12.2022 | | 1.100 | 1.113 | 0,03 |
| | | | 3.944 | 0,11 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Pakistan Government International Bond** | | | | |
| 6,875 % fällig am 05.12.2027 | | 3.900 | 3.949 | 0,10 |
| 8,250 % fällig am 15.04.2024 | | 9.500 | 10.411 | 0,28 |
| | | | 14.360 | 0,38 |
| Summe Pakistan | | | 18.304 | 0,49 |
| **PANAMA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 18.11.2048 | | 5.900 | 6.979 | 0,18 |
| **ENA Norte Trust** | | | | |
| 4,950 % fällig am 25.04.2028 | | 3.149 | 3.259 | 0,09 |
| | | | 10.238 | 0,27 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Panama Government International Bond** | | | | |
| 4,300 % fällig am 29.04.2053 | | 9.200 | 10.143 | 0,27 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2047 | | 6.100 | 6.907 | 0,18 |
| 7,125 % fällig am 29.01.2026 | | 2.000 | 2.493 | 0,07 |
| 8,125 % fällig am 28.04.2034 | | 300 | 426 | 0,01 |
| 8,875 % fällig am 30.09.2027 | | 1.335 | 1.894 | 0,05 |
| 9,375 % fällig am 01.04.2029 | | 2.000 | 3.008 | 0,08 |
| | | | 24.871 | 0,66 |
| Summe Panama | | | 35.109 | 0,93 |
| **PARAGUAY** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Paraguay Government International Bond** | | | | |
| 4,700 % fällig am 27.03.2027 | | 2.400 | 2.606 | 0,07 |
| 6,100 % fällig am 11.08.2044 | | 4.800 | 5.730 | 0,15 |
| Summe Paraguay | | | 8.336 | 0,22 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **PERU** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Peru LNG SRL** | | | | |
| 5,375 % fällig am 22.03.2030 | $ | 1.700 | $ 1.834 | 0,05 |
| **Petroleos del Peru S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 19.06.2032 | | 2.800 | 3.069 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 19.06.2047 | | 5.000 | 5.700 | 0,15 |
| | | | 10.603 | 0,28 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Fondo MIVIVIENDA S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 3.600 | 3.667 | 0,10 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,625 % fällig am 18.11.2050 | | 1.300 | 1.794 | 0,05 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 31.500 | 10.459 | 0,28 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 13.400 | 4.578 | 0,12 |
| 6,550 % fällig am 14.03.2037 | $ | 1.243 | 1.759 | 0,05 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | PEN | 65.900 | 23.513 | 0,63 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 21.400 | 8.098 | 0,21 |
| 8,750 % fällig am 21.11.2033 | $ | 5.071 | 8.202 | 0,22 |
| | | | 62.070 | 1,66 |
| Summe Peru | | | 72.673 | 1,94 |
| **PHILIPPINEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Power Sector Assets & Liabilities Management Corp.** | | | | |
| 7,390 % fällig am 02.12.2024 | | 4.700 | 5.748 | 0,15 |
| **POLEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Polen Government International Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 06.04.2026 | | 3.600 | 3.812 | 0,10 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | |
| 5,298 % fällig am 30.09.2020 | | 1.726 | 1.760 | 0,05 |
| 6,750 % fällig am 30.09.2019 | | 6.700 | 6.762 | 0,18 |
| | | | 8.522 | 0,23 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **State Of Katar** | | | | |
| 2,983 % fällig am 21.12.2020 | | 22.900 | 22.843 | 0,61 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Katar Government International Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 02.06.2026 | | 10.000 | 10.304 | 0,27 |
| 3,375 % fällig am 14.03.2024 | | 9.400 | 9.725 | 0,26 |
| 4,000 % fällig am 14.03.2029 | | 19.800 | 21.372 | 0,57 |
| 4,500 % fällig am 20.01.2022 | | 7.000 | 7.363 | 0,20 |
| 4,817 % fällig am 14.03.2049 | | 18.900 | 21.708 | 0,58 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 2.300 | 2.746 | 0,07 |
| | | | 73.218 | 1,95 |
| Summe Katar | | | 104.583 | 2,79 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Rumänien Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 08.12.2026 | € | 3.900 | 4.711 | 0,13 |
| 2,375 % fällig am 19.04.2027 | | 100 | 124 | 0,00 |
| 2,875 % fällig am 26.05.2028 | | 1.600 | 2.031 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 03.04.2034 | | 700 | 880 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 29.10.2035 | | 100 | 131 | 0,00 |
| 4,625 % fällig am 03.04.2049 | | 3.400 | 4.691 | 0,13 |
| | | | 12.568 | 0,33 |
| Summe Rumänien | | | | |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **MMK International Capital DAC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 13.06.2024 | $ | 8.800 | 8.933 | 0,24 |
| **SCF Capital Designated Activity Co.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 16.06.2023 | | 1.200 | 1.245 | 0,03 |
| | | | 10.178 | 0,27 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Russland Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 04.12.2025 | € | 13.500 | $ 16.483 | 0,44 |
| 4,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 15.000 | 15.573 | 0,42 |
| 5,100 % fällig am 28.03.2035 | | 38.600 | 41.998 | 1,12 |
| 5,625 % fällig am 04.04.2042 | | 7.400 | 8.695 | 0,23 |
| | | | 82.749 | 2,21 |
| Summe Russland | | | 92.927 | 2,48 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Saudi Arabian Oil Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 16.04.2022 | | 6.900 | 6.966 | 0,19 |
| 4,375 % fällig am 16.04.2049 | | 1.900 | 1.930 | 0,05 |
| | | | 8.896 | 0,24 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 2.200 | 2.229 | 0,06 |
| 3,250 % fällig am 26.10.2026 | | 200 | 204 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 04.03.2028 | | 20.500 | 21.094 | 0,56 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 5.000 | 5.330 | 0,14 |
| 4,375 % fällig am 16.04.2029 | | 16.800 | 18.188 | 0,49 |
| 4,500 % fällig am 17.04.2030 | | 5.300 | 5.791 | 0,15 |
| 5,250 % fällig am 16.01.2050 | | 5.000 | 5.698 | 0,15 |
| | | | 58.534 | 1,56 |
| Summe Saudi-Arabien | | | 67.430 | 1,80 |
| **SENEGAL** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Senegal Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 13.03.2028 | € | 2.600 | 2.976 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 30.07.2024 | $ | 300 | 322 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 23.05.2033 | | 4.900 | 4.752 | 0,13 |
| 6,750 % fällig am 13.03.2048 | | 800 | 754 | 0,02 |
| 8,750 % fällig am 13.05.2021 | | 4.500 | 4.922 | 0,13 |
| Summe Senegal | | | 13.726 | 0,37 |
| **SERBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Serbien Government International Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 26.06.2029 | € | 21.000 | 23.910 | 0,64 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | $ | 8.900 | 8.889 | 0,24 |
| 4,000 % fällig am 25.01.2024 | | 2.400 | 2.490 | 0,06 |
| Summe Singapur | | | 11.379 | 0,30 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AngloGold Ashanti Holdings PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.04.2040 | | 200 | 217 | 0,01 |
| **Eskom Holdings SOC Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 26.01.2021 | | 9.400 | 9.502 | 0,25 |
| 6,350 % fällig am 10.08.2028 | | 3.900 | 4.230 | 0,11 |
| 6,750 % fällig am 06.08.2023 | | 14.100 | 14.804 | 0,40 |
| **FirstRand Bank Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 23.04.2028 (h)(j) | | 6.700 | 7.018 | 0,19 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | | 5.800 | 6.123 | 0,16 |
| **SASOL Financing USA LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 27.03.2024 | | 14.300 | 15.506 | 0,41 |
| 6,500 % fällig am 27.09.2028 | | 6.300 | 7.077 | 0,19 |
| | | | 64.477 | 1,72 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 4,300 % fällig am 12.10.2028 | | 200 | 197 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 14.04.2026 | | 1.700 | 1.762 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 12.10.2046 | | 10.200 | 9.855 | 0,26 |
| 5,375 % fällig am 24.07.2044 | | 400 | 404 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 16.09.2025 | $ | 2.400 | $ 2.634 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 22.06.2030 | | 17.800 | 19.344 | 0,51 |
| | | | 34.196 | 0,91 |
| Summe Südafrika | | | 98.673 | 2,63 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **National Savings Bank** | | | | |
| 5,150 % fällig am 10.09.2019 | | 9.000 | 9.004 | 0,24 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.04.2023 | | 1.500 | 1.490 | 0,04 |
| 6,125 % fällig am 03.06.2025 | | 3.100 | 3.028 | 0,08 |
| 6,200 % fällig am 11.05.2027 | | 5.200 | 4.940 | 0,13 |
| 6,250 % fällig am 04.10.2020 | | 6.900 | 6.995 | 0,19 |
| 6,250 % fällig am 27.07.2021 | | 2.331 | 2.364 | 0,06 |
| 6,825 % fällig am 18.07.2026 | | 1.200 | 1.199 | 0,03 |
| 6,850 % fällig am 03.11.2025 | | 4.500 | 4.521 | 0,12 |
| 7,850 % fällig am 14.03.2029 | | 3.600 | 3.721 | 0,10 |
| | | | 28.258 | 0,75 |
| Summe Sri Lanka | | | 37.262 | 0,99 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banque Ouest Africaine de Developpement** | | | | |
| 5,000 % fällig am 27.07.2027 | | 3.000 | 3.104 | 0,08 |
| **TANSANIA** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Ministry of Finance of Tansania** | | | | |
| 7,417 % - 7,763 % fällig am 23.06.2022 | | 7.900 | 7.890 | 0,21 |
| 7,741 % fällig am 10.12.2019 | | 10.917 | 10.991 | 0,30 |
| | | | 18.881 | 0,51 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Tansania Government International Bond** | | | | |
| 8,688 % fällig am 09.03.2020 | | 844 | 861 | 0,02 |
| Summe Tansania | | | 19.742 | 0,53 |
| **THAILAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Thaioil Treasury Center Co. Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 20.11.2048 | | 3.000 | 3.634 | 0,10 |
| **TRINIDAD UND TOBAGO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Trinidad Petroleum Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 08.05.2022 | | 2.565 | 2.552 | 0,07 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Trinidad & Tobago Government International Bond** | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.08.2026 | | 1.100 | 1.102 | 0,03 |
| Summe Trinidad und Tobago | | | 3.654 | 0,10 |
| **TUNESIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Banque Centrale de Tunisie International Bond** | | | | |
| 3,280 % fällig am 09.08.2027 | ¥ | 200.000 | 1.482 | 0,04 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** | | | | |
| 5,004 % fällig am 06.04.2023 | $ | 1.200 | 1.161 | 0,03 |
| 5,800 % fällig am 21.02.2022 | | 400 | 402 | 0,01 |
| 5,800 % fällig am 21.02.2022 (j) | | 40.500 | 40.748 | 1,09 |
| **Turkish Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2028 | | 5.408 | 4.981 | 0,13 |
| **Turkiye Is Bankasi A/S** | | | | |
| 6,125 % fällig am 25.04.2024 | | 3.000 | 2.757 | 0,07 |
| | | | 50.049 | 1,33 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Akbank T.A.S.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 06.10.2019 | € | 4.800 | $ 5.452 | 0,15 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Credit Bank of Türkei** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.09.2022 | $ | 15.600 | 14.649 | 0,39 |
| 5,375 % fällig am 24.10.2023 | | 5.300 | 5.031 | 0,13 |
| 8,250 % fällig am 24.01.2024 | | 8.100 | 8.481 | 0,23 |
| **Türkei Government International Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 23.03.2023 | | 8.100 | 7.395 | 0,20 |
| 4,625 % fällig am 31.03.2025 | € | 2.200 | 2.503 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 09.10.2026 | $ | 6.000 | 5.385 | 0,14 |
| 5,125 % fällig am 17.02.2028 | | 21.000 | 18.805 | 0,50 |
| 5,750 % fällig am 22.03.2024 | | 300 | 293 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047 | | 17.000 | 14.294 | 0,38 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2027 | | 30.100 | 28.685 | 0,77 |
| 6,000 % fällig am 14.01.2041 | | 21.620 | 18.728 | 0,50 |
| 6,125 % fällig am 24.10.2028 | | 17.800 | 16.822 | 0,45 |
| 6,750 % fällig am 30.05.2040 | | 2.150 | 2.016 | 0,05 |
| 6,875 % fällig am 17.03.2036 | | 14.770 | 14.190 | 0,38 |
| 7,000 % fällig am 05.06.2020 | | 800 | 819 | 0,02 |
| 7,250 % fällig am 23.12.2023 | | 14.100 | 14.598 | 0,39 |
| 7,625 % fällig am 26.04.2029 | | 3.800 | 3.900 | 0,10 |
| 8,000 % fällig am 14.02.2034 | | 1.415 | 1.500 | 0,04 |
| | | | 178.094 | 4,75 |
| Summe Türkei | | | 233.595 | 6,23 |
| **UKRAINE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.05.2040 | | 20.800 | 14.968 | 0,40 |
| 6,750 % fällig am 20.06.2026 | € | 13.900 | 16.807 | 0,45 |
| 7,375 % fällig am 25.09.2032 | $ | 7.700 | 7.591 | 0,20 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2020 | | 21.900 | 22.649 | 0,60 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2021 | | 7.600 | 7.959 | 0,21 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2022 | | 15.300 | 16.239 | 0,43 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | | 10.100 | 10.713 | 0,29 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2024 | | 8.600 | 8.992 | 0,24 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2027 | | 5.000 | 5.153 | 0,14 |
| Summe Ukraine | | | 111.071 | 2,96 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC** | | | | |
| 3,650 % fällig am 02.11.2029 | | 2.200 | 2.318 | 0,06 |
| **DP World PLC** | | | | |
| 6,850 % fällig am 02.07.2037 | | 2.650 | 3.336 | 0,09 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 26.600 | 26.766 | 0,72 |
| **Kuwait Projects Co. SPC Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 23.02.2027 | | 5.000 | 4.986 | 0,13 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | 37.406 | 1,00 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Afren PLC** | | | | |
| 0,112 % fällig am 25.04.2049 ^(i) | | 10.512 | 1.310 | 0,04 |
| 11,500 % fällig am 01.02.2016 ^ | | 8.934 | 75 | 0,00 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | | 1.300 | 1.420 | 0,04 |
| **State Savings Bank of Ukraine Via SSB PLC** | | | | |
| 9,375 % fällig am 10.03.2023 | | 640 | 668 | 0,02 |
| **Ukreximbank Via Biz Finance PLC** | | | | |
| 9,625 % fällig am 27.04.2022 | | 425 | 442 | 0,01 |
| | | | 3.915 | 0,11 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.12.2049 (d) | £ | 0 | 515 | 0,01 |
| 1,584 % fällig am 21.12.2049 | | 6.688 | 8.456 | 0,23 |
| 2,284 % fällig am 21.12.2049 | | 735 | 950 | 0,02 |
| 2,784 % fällig am 21.12.2049 | | 367 | 467 | 0,01 |
| 3,284 % fällig am 21.12.2049 | | 210 | 268 | 0,01 |
| 3,784 % fällig am 21.12.2049 | | 210 | 263 | 0,01 |
| | | | 10.919 | 0,29 |
| Summe Großbritannien | | | 14.834 | 0,40 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.04.2036 | $ | 6.432 | $ 5.805 | 0,15 |
| **Argent Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.05.2035 | | 752 | 726 | 0,02 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 1.487 | 1.297 | 0,03 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.02.2037 | | 3.300 | 3.252 | 0,09 |
| 3,154 % fällig am 25.11.2035 | | 3.660 | 3.705 | 0,10 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.11.2036 | | 370 | 206 | 0,01 |
| 2,774 % fällig am 25.06.2035 | | 170 | 171 | 0,00 |
| 6,002 % fällig am 25.11.2036 | | 1.270 | 767 | 0,02 |
| **GSAA Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.05.2047 | | 1.395 | 1.102 | 0,03 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 3,754 % fällig am 25.02.2033 | | 513 | 515 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 5,311 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 3.174 | 3.190 | 0,09 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.11.2036 | | 1.536 | 1.091 | 0,03 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.02.2037 | | 1.861 | 1.136 | 0,03 |
| 3,169 % fällig am 25.01.2035 | | 185 | 183 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.02.2037 | | 251 | 118 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.04.2037 | | 1.054 | 835 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | | 814 | 564 | 0,02 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,924 % fällig am 25.09.2035 | | 3.900 | 3.482 | 0,09 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,797 % fällig am 25.08.2036 | | 808 | 462 | 0,01 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,714 % fällig am 25.09.2047 | | 610 | 596 | 0,02 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.08.2037 | | 928 | 856 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.11.2036 | | 90 | 85 | 0,00 |
| 2,754 % fällig am 25.03.2036 | | 1.700 | 1.668 | 0,04 |
| 3,304 % fällig am 25.10.2037 | | 2.005 | 1.679 | 0,05 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | | 1.717 | 1.725 | 0,05 |
| | | | 35.216 | 0,94 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DXC Technology Co.** | | | | |
| 3,470 % fällig am 01.03.2021 | | 2.769 | 2.769 | 0,07 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 09.01.2023 | | 100 | 101 | 0,00 |
| 3,150 % fällig am 07.09.2022 | | 200 | 203 | 0,01 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | | 11.200 | 12.600 | 0,33 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 5.724 | 6.404 | 0,17 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 9.694 | 11.172 | 0,30 |
| | | | 33.249 | 0,88 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 4,479 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 12 | 12 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 6,247 % fällig am 26.05.2037 | | 6.640 | 5.896 | 0,16 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 4,351 % fällig am 25.01.2035 | | 11 | 10 | 0,00 |
| 4,392 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 212 | 201 | 0,01 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.05.2035 | | 136 | 139 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,291 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 420 | 410 | 0,01 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 3,054 % fällig am 25.10.2036 | | 2.192 | 1.787 | 0,05 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 1.515 | 934 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,675 % fällig am 20.05.2036 ^ | $ | 144 | $ 138 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 2,860 % fällig am 25.11.2034 | | 493 | 454 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,734 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 1.444 | 1.253 | 0,03 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.01.2036 | | 229 | 201 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,396 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 64 | 65 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,504 % fällig am 19.10.2035 | | 156 | 121 | 0,00 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.01.2036 | | 961 | 965 | 0,03 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | | 208 | 206 | 0,01 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.02.2037 | | 1.758 | 1.612 | 0,04 |
| 2,584 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 583 | 567 | 0,02 |
| 3,044 % fällig am 25.07.2045 | | 592 | 559 | 0,01 |
| 3,856 % fällig am 25.11.2037 | | 417 | 409 | 0,01 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.03.2056 | | 749 | 730 | 0,02 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 | | 3.742 | 3.686 | 0,10 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 736 | 686 | 0,02 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,298 % fällig am 25.09.2037 | | 41 | 42 | 0,00 |
| 4,566 % fällig am 25.09.2034 | | 2 | 1 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.02.2037 | | 1.828 | 1.771 | 0,05 |
| **SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,316 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 1.635 | 1.566 | 0,04 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 6,040 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 1.650 | 765 | 0,02 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.05.2034 | | 242 | 220 | 0,01 |
| 3,574 % fällig am 25.01.2046 | | 124 | 123 | 0,00 |
| 4,077 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 302 | 298 | 0,01 |
| 4,229 % fällig am 25.03.2036 | | 2.535 | 2.485 | 0,07 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,904 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 32 | 29 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 25.10.2036 | | 907 | 905 | 0,02 |
| | | | 29.246 | 0,78 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 4,493 % fällig am 01.12.2035 | | 30 | 30 | 0,00 |
| 4,863 % fällig am 01.03.2036 | | 20 | 22 | 0,00 |
| 5,270 % fällig am 01.01.2036 | | 21 | 22 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.02.2038 | | 3 | 3 | 0,00 |
| | | | 77 | 0,00 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 (j) | | 7.900 | 8.164 | 0,22 |
| Summe USA | | | 105.952 | 2,82 |
| **URUGUAY** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Uruguay Government International Bond** | | | | |
| 4,375 % fällig am 27.10.2027 | | 365 | 395 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 23.01.2031 | | 9.778 | 10.601 | 0,28 |
| 4,975 % fällig am 20.04.2055 | | 4.500 | 4.978 | 0,13 |
| 5,100 % fällig am 18.06.2050 | | 14.100 | 15.898 | 0,43 |
| 6,875 % fällig am 28.09.2025 | | 2.879 | 3.412 | 0,09 |
| 7,875 % fällig am 15.01.2033 | | 10.850 | 15.604 | 0,42 |
| 9,875 % fällig am 20.06.2022 | UYU | 43.315 | 1.223 | 0,03 |
| Summe Uruguay | | | 52.111 | 1,39 |
| **VENEZUELA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 ^ | $ | 73.690 | 11.791 | 0,31 |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 ^ | | 19.365 | 3.195 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | | 3.500 | 560 | 0,01 |
| | | | 15.546 | 0,41 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Venezuela Government International Bond** | | | |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^ | $ 19.650 | $ 5.207 | 0,14 |
| 7,650 % fällig am 21.04.2025 ^ | 6.624 | 1.805 | 0,05 |
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 ^ | 20.130 | 5.360 | 0,14 |
| 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^ | 12.483 | 3.433 | 0,09 |
| 9,000 % fällig am 07.05.2023 ^ | 9.878 | 2.716 | 0,07 |
| 9,250 % fällig am 15.09.2027 ^ | 13.410 | 3.922 | 0,11 |
| 9,250 % fällig am 07.05.2028 ^ | 11.868 | 3.249 | 0,09 |
| 11,950 % fällig am 05.08.2031 ^ | 2.930 | 846 | 0,02 |
| | | 26.538 | 0,71 |
| Summe Venezuela | | 42.084 | 1,12 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Celestial Dynasty Ltd.** | | | |
| 4,250 % fällig am 27.06.2029 | 17.700 | 17.895 | 0,48 |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** | | | |
| 4,875 % fällig am 07.10.2020 | 1.298 | 1.322 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | 1.100 | 1.150 | 0,03 |
| Summe Jungferninseln (Britisch) | | 20.367 | 0,54 |
| **SAMBIA** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Sambia Government International Bond** | | | |
| 8,500 % fällig am 14.04.2024 | 2.900 | 1.965 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (k)** | | | | |
| | | | $ 869 | 0,02 |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **JPMorgan Structured Products BV** | | | | |
| 17,053 % fällig am 21.11.2019 (d)(e)(i) | EGP | 40.900 | 2.313 | 0,06 |
| **Nigeria Treasury Bills** | | | | |
| 13,161 % fällig am 06.02.2020 (d)(e) | NGN | 3.143.100 | 8.111 | 0,22 |
| 13,203 % fällig am 19.12.2019 (d)(e) | | 1.476.500 | 3.877 | 0,10 |
| 13,394 % fällig am 23.04.2020 (d)(e) | | 2.514.500 | 6.323 | 0,17 |
| 13,613 % fällig am 23.04.2020 (d)(e) | | 1.236.700 | 3.110 | 0,08 |
| 14,021 % fällig am 23.04.2020 (d)(e) | | 7.180.900 | 18.057 | 0,48 |
| 13,853 % fällig am 14.05.2020 (d)(e) | | 2.000.000 | 4.995 | 0,13 |
| 13,963 % fällig am 04.06.2020 (d)(e) | | 850.000 | 2.109 | 0,06 |
| | | | 48.895 | 1,30 |
| **ÄGYPTEN TREASURY BILLS** | | | | |
| 19,150 % fällig am 24.12.2019 (d)(e) | EGP | 19.225 | 1.063 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **NIGERIA TREASURY BILLS** | | | | |
| 12,373 % fällig am 02.01.2020 (d)(e) | EGP | 1.604.600 | $ 4.192 | 0,11 |
| 12,787 % fällig am 02.04.2020 (d)(e) | | 2.159.500 | 5.468 | 0,15 |
| 13,093 % fällig am 13.02.2020 (d)(e) | | 1.084.800 | 2.793 | 0,08 |
| 13,273 % fällig am 28.11.2019 (d)(e) | | 2.461.000 | 6.518 | 0,17 |
| 13,379 % fällig am 19.03.2020 (d)(e) | | 618.400 | 1.573 | 0,04 |
| | | | 20.544 | 0,55 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 71.371 | 1,90 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | | 12.491.782 | 125.105 | 3,34 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **3.685.879 $** | **98,24** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 701 | $ 1.218 | 0,04 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1.248 | 3.079 | 0,08 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 51 | 61 | 0,00 |
| | | | | $ 4.358 | 0,12 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 4.358** | **0,12** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Deutsche Bank AG | 1,000 % | 20.12.2019 | € 500 | $ 0 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | $ 1.500 | 116 | 0,01 |
| | | | | $ 116 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-30 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 163.800 | $ 207 | 0,01 |
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 45.000 | 553 | 0,01 |
| | | | | $ 760 | 0,02 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettoverm-ögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 21.06.2027 | $ 55.700 | $ 2.977 | 0,08 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.12.2022 | 149.170 | 1.512 | 0,04 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 21.12.2046 | 1.200 | (104) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 15.06.2046 | 600 | (51) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 31.830 | (2.614) | (0,07) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 % | 18.09.2024 | € 13.600 | $ (309) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | 10.800 | (592) | (0,02) |
| | | | | | $ 819 | 0,02 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 1.695** | **0,05** |

(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) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/-verkauf | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 % | 18.09.2019 | 4.100 | $ (7) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 3.100 | (6) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (13) | $ 0 | 0,00 |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Türkei Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2022 | $ 24.900 | $ 1.030 | $ 1.084 | $ 2.114 | 0,05 |
| GST | Türkei Government International Bond | (1,000) | 20.12.2022 | 11.700 | 492 | 502 | 994 | 0,03 |
| | | | | | $ 1.522 | $ 1.586 | $ 3.108 | 0,08 |

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

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Brasilien Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | $ 1.100 | $ (68) | $ 73 | $ 5 | 0,00 |
| | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.09.2021 | 400 | (17) | 18 | 1 | 0,00 |
| | Kolumbien Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 7.100 | (385) | 448 | 63 | 0,00 |
| | Indonesien Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 6.800 | (422) | 486 | 64 | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 4.700 | (198) | 251 | 53 | 0,00 |
| BPS | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 1.700 | 0 | 5 | 5 | 0,00 |
| | Kolumbien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 1.700 | (29) | 54 | 25 | 0,00 |
| | Indonesien Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 12.000 | (462) | 576 | 114 | 0,01 |
| | Indonesien Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 19.900 | (614) | 884 | 270 | 0,01 |
| | Mexiko Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 3.800 | 11 | 3 | 14 | 0,00 |
| BRC | Kolumbien Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 1.500 | (85) | 98 | 13 | 0,00 |
| | Indonesien Government International Bond | 1,000 | 20.03.2024 | 7.800 | (1.076) | 1.125 | 49 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 4.700 | (335) | 333 | (2) | 0,00 |
| CBK | Kolumbien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 2.100 | (21) | 30 | 9 | 0,00 |
| | Indonesien Government International Bond | 1,000 | 20.03.2024 | 3.800 | (519) | 543 | 24 | 0,00 |
| | Mexiko Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 2.600 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | Uruguay Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 17.000 | (163) | 141 | (22) | 0,00 |
| DUB | Kolumbien Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 3.600 | (200) | 232 | 32 | 0,00 |
| | Ägypten Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 3.600 | (105) | 75 | (30) | 0,00 |
| | Mexiko Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 1.400 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | Panama Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 7.200 | (55) | 210 | 155 | 0,01 |
| | Penerbangan Malaysia Bhd. | 1,000 | 20.03.2020 | 4.100 | (35) | 64 | 29 | 0,00 |
| FBF | Kolumbien Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 1.300 | (70) | 82 | 12 | 0,00 |
| | Ecuador Government International Bond | 5,000 | 20.06.2021 | 6.000 | (387) | 404 | 17 | 0,00 |
| | Ecuador Government International Bond | 5,000 | 20.12.2021 | 6.400 | (487) | 460 | (27) | 0,00 |
| | Ägypten Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 7.200 | (614) | 360 | (254) | (0,01) |
| | Indonesien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 4.100 | (263) | 316 | 53 | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 10.000 | 122 | 117 | 239 | 0,01 |
| GST | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 2.400 | (150) | 160 | 10 | 0,00 |
| | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 200 | (7) | 2 | (5) | 0,00 |
| | Chile Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 4.300 | 12 | 37 | 49 | 0,00 |
| | Kolumbien Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 2.700 | (40) | 64 | 24 | 0,00 |
| | Indonesien Government International Bond | 1,000 | 20.03.2024 | 10.100 | (1.381) | 1.445 | 64 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| HUS | Brasilien Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | $ 21.100 | $ 34 | $ 1 | $ 35 | 0,00 |
| | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 17.400 | 32 | 40 | 72 | 0,00 |
| | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (4) | 3 | (1) | 0,00 |
| | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 600 | (18) | 4 | (14) | 0,00 |
| | Kolumbien Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 5.000 | (283) | 327 | 44 | 0,00 |
| | Mexiko Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 500 | (8) | 8 | 0 | 0,00 |
| | Mexiko Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 700 | (11) | 8 | (3) | 0,00 |
| JPM | Indonesien Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 12.100 | (755) | 870 | 115 | 0,01 |
| | Penerbangan Malaysia Bhd. | 1,000 | 20.09.2020 | 8.500 | (102) | 195 | 93 | 0,00 |
| MYC | Indonesien Government International Bond | 1,000 | 20.03.2021 | 7.500 | (543) | 631 | 88 | 0,00 |
| | Indonesien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 16.500 | (27) | 105 | 78 | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 18.000 | 98 | 60 | 158 | 0,01 |
| NGF | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 9.600 | (620) | 617 | (3) | 0,00 |
| UAG | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 350 | (25) | 25 | 0 | 0,00 |
| | Indonesien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 1.200 | (79) | 95 | 16 | 0,00 |
| | | | | | $ (10.339) | $ 12.085 | $ 1.746 | 0,05 |

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

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 161 | $ | 183 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 02/2020 | $ | 7.908 | EGP | 145.667 | 240 | 0 | 240 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | € | 20.596 | $ | 23.120 | 0 | (335) | (335) | (0,01) |
| | 07/2019 | TRY | 79.665 | | 13.693 | 5 | (2) | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 18.378 | £ | 14.490 | 63 | 0 | 63 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 13.693 | TRY | 79.219 | 1 | (6) | (5) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 14.490 | $ | 18.406 | 0 | (63) | (63) | 0,00 |
| | 09/2019 | CNY | 60.335 | | 8.710 | 0 | (72) | (72) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 8.928 | IDR | 128.721.583 | 97 | 0 | 97 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € | 150.475 | $ | 168.289 | 0 | (3.072) | (3.072) | (0,08) |
| | 08/2019 | AUD | 462 | | 322 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 75.022 | | 3.776 | 0 | (102) | (102) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | € | 17.032 | | 19.394 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 165.500 | | 1.519 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 20.690 | € | 18.205 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 326 | ZAR | 4.721 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 18.205 | $ | 20.743 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 18.826 | | 5.591 | 0 | (110) | (110) | (0,01) |
| | 02/2020 | $ | 7.908 | EGP | 145.827 | 249 | 0 | 249 | 0,01 |
| | 04/2020 | NGN | 2.383.117 | $ | 6.286 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| DUB | 08/2019 | ARS | 121.766 | | 2.513 | 0 | (213) | (213) | (0,01) |
| GLM | 07/2019 | € | 1.599 | | 1.800 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 8.240 | RUB | 546.862 | 414 | 0 | 414 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 144 | MXN | 2.869 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 8.886 | IDR | 128.402.700 | 116 | 0 | 116 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 10.824 | $ | 557 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 554 | MXN | 10.824 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 17.343 | EGP | 307.665 | 295 | 0 | 295 | 0,01 |
| | 02/2020 | | 1.871 | | 34.514 | 60 | 0 | 60 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | € | 533 | $ | 606 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 199 | | 253 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | SGD | 192 | | 142 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 235 | € | 207 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 3.683 | EGP | 67.538 | 284 | 0 | 284 | 0,01 |
| | 10/2019 | MXN | 10.824 | $ | 553 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 553 | MXN | 10.824 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 10.409 | EGP | 187.362 | 359 | 0 | 359 | 0,01 |
| JPM | 07/2019 | € | 11.479 | $ | 12.905 | 0 | (167) | (167) | (0,01) |
| | 02/2020 | NGN | 2.930.922 | | 7.858 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| MSB | 09/2019 | RUB | 543.005 | | 8.206 | 0 | (310) | (310) | (0,01) |
| MYI | 07/2019 | £ | 5 | | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 14.490 | | 18.339 | 0 | (101) | (101) | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 104.495 | | 17.597 | 0 | (459) | (459) | (0,01) |
| UAG | 07/2019 | € | 313 | | 356 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.538 | ¥ | 165.500 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 165.500 | $ | 1.541 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | MYR | 902 | | 217 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 2.244 | $ (5.123) | $ (2.879) | (0,08) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse M Retail AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD 5.014 | $ 3.499 | $ 0 | $ (20) | $ (20) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 7 | AUD 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | 3.069 | 4.391 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD 5.663 | $ 3.952 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 3.433 | AUD 4.960 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| | 08/2019 | 3.071 | 4.386 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | 3.266 | 4.708 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | AUD 10 | $ 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 68 | AUD 98 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | AUD 21 | $ 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 3.439 | AUD 4.960 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| | | | | $ 152 | $ (42) | $ 110 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ 26.458 | CHF 26.538 | $ 760 | $ 0 | $ 760 | 0,02 |
| CBK | 07/2019 | CHF 27.676 | $ 28.264 | 0 | (122) | (122) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 26.327 | CHF 26.384 | 733 | 0 | 733 | 0,02 |
| | 08/2019 | 28.346 | 27.676 | 123 | 0 | 123 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | 26.475 | 26.647 | 856 | 0 | 856 | 0,02 |
| HUS | 07/2019 | CHF 27.721 | $ 28.374 | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 28.456 | CHF 27.721 | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 241 | 240 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 619 | 618 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | | | | $ 2.551 | $ (180) | $ 2.371 | 0,06 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 680.954 | $ 773.836 | $ 0 | $ (1.635) | $ (1.635) | (0,04) |
| | 08/2019 | $ 775.808 | € 680.954 | 1.644 | 0 | 1.644 | 0,04 |
| BPS | 07/2019 | € 12.374 | $ 14.095 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 58.163 | € 51.636 | 640 | 0 | 640 | 0,02 |
| BRC | 07/2019 | 708.152 | 633.142 | 12.871 | 0 | 12.871 | 0,34 |
| CBK | 07/2019 | € 683.376 | $ 776.658 | 0 | (1.571) | (1.571) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ 23.194 | € 20.404 | 55 | (14) | 41 | 0,00 |
| | 08/2019 | 775.878 | 680.954 | 1.574 | 0 | 1.574 | 0,04 |
| GLM | 07/2019 | 703.313 | 630.156 | 14.309 | 0 | 14.309 | 0,38 |
| MYI | 07/2019 | 707.979 | 633.142 | 13.043 | 0 | 13.043 | 0,35 |
| RBC | 07/2019 | 5.681 | 5.009 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | 10.141 | 8.964 | 68 | 0 | 68 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 21.451 | 19.086 | 284 | 0 | 284 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | € 4.121 | $ 4.651 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | | | | $ 44.515 | $ (3.261) | $ 41.254 | 1,10 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | £ 39 | $ 48 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 801 | £ 630 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 38.724 | $ 49.115 | 0 | (168) | (168) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 932 | £ 735 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | 49.191 | 38.724 | 170 | 0 | 170 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | £ 38.683 | $ 49.151 | 1 | (81) | (80) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 46.879 | £ 36.999 | 209 | 0 | 209 | 0,01 |
| | 08/2019 | 49.037 | 38.535 | 82 | 0 | 82 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | 1.360 | 1.075 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | £ 130 | $ 164 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | $ 46.829 | £ 36.999 | 259 | 0 | 259 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | 46.126 | 36.504 | 333 | 0 | 333 | 0,01 |
| | | | | $ 1.066 | $ (251) | $ 815 | 0,02 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2019 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ 29 | SGD 40 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | SGD 3.601 | $ 2.659 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 2.432 | SGD 3.356 | 48 | 0 | 48 | 0,01 |
| | 08/2019 | 2.668 | 3.611 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | 2.423 | 3.328 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| DUB | 07/2019 | 2.422 | 3.334 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | SGD 3.662 | $ 2.704 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 2.712 | SGD 3.670 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SGD 3.554 | $ 2.620 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 15 | SGD 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SGD 13 | $ 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 2.775 | SGD 3.763 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | 2.374 | 3.271 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | 22 | 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | 157 | 212 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SGD 3.134 | $ 2.317 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 141 | SGD 193 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | 3.618 | 4.893 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 23 | 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | 252 | 346 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | $ 192 | $ (13) | $ 179 | 0,01 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 46.704** | **1,24** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2049 | $ 1.000 | $ (1.057) | (0,03) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (1.057)** | **(0,03)** |
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 2,980 % fällig am 25.10.2019 | 8.000 | 8.008 | 0,21 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 8.008** | **0,21** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 3.745.587** | **99,83** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 6.334** | **0,17** |
| **Nettovermögen** | | **$ 3.751.921** | **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.**

**(d) 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 | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Afren PLC | 0,112 % | 25.04.2049 | 30.04.2015 | $ 10.148 | $ 1.310 | 0,04 |
| JPMorgan Structured Products BV | 17,053 | 25.04.2049 | 21.02.2019 | 2.197 | 2.313 | 0,06 |
| | | | | $ 12.345 | $ 3.623 | 0,10 |

**(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 23.723 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 36.275 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 260 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 869 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | $ (887) | $ 869 | $ 869 | 0,02 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (887)** | **$ 869** | **$ 869** | **0,02** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 154.416 | $ 3.487.479 | $ 43.984 | $ 3.685.879 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 8.008 | 0 | 8.008 |
| Finanzderivate[3] | 4.358 | 48.399 | 0 | 52.757 |
| Leerverkäufe | 0 | (1.057) | 0 | (1.057) |
| **Summen** | **$ 158.774** | **$ 3.542.829** | **$ 43.984** | **$ 3.745.587** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 197.256 | $ 2.145.932 | $ 29.640 | $ 2.372.828 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 8.005 | 0 | 8.005 |
| Finanzderivate[3] | 5.766 | 2.590 | 0 | 8.356 |
| Leerverkäufe | 0 | (1.047) | 0 | (1.047) |
| **Summen** | **$ 203.022** | **$ 2.155.480** | **$ 29.640** | **$ 2.388.142** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | 2,000 % | 14.02.2019 | TBD[1] | $ (5.145) | $ (5.185) | (0,14) |
| | 2,050 | 18.06.2019 | TBD[1] | (3.366) | (3.368) | (0,09) |
| JML | 1,600 | 16.04.2019 | TBD[1] | (1.678) | (1.684) | (0,04) |
| | 1,600 | 10.05.2019 | TBD[1] | (2.979) | (2.985) | (0,08) |
| | 2,000 | 22.05.2019 | TBD[1] | (2.168) | (2.173) | (0,06) |
| SGY | 2,250 | 14.06.2019 | 05.07.2019 | (8.117) | (8.126) | (0,22) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (23.521)** | **(0,63)** |

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 1.191 | $ (1.050) | $ 141 |
| BPS | 2.928 | (3.040) | (112) |
| BRC | 9.754 | (8.850) | 904 |
| CBK | 1.201 | (950) | 251 |
| DUB | 20 | (180) | (160) |
| FBF | 40 | (240) | (200) |
| GLM | 16.044 | (15.050) | 994 |
| GST | 1.136 | (1.290) | (154) |
| HUS | 774 | (810) | (36) |
| IND | 38 | 0 | 38 |
| JPM | 74 | (290) | (216) |
| MSB | (310) | 0 | (310) |
| MYC | 324 | (373) | (49) |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| MYI | $ 13.048 | $ (11.590) | $ 1.458 |
| NGF | (3) | 260 | 257 |
| RBC | 23 | 0 | 23 |
| RYL | 68 | (120) | (52) |
| SCX | 27 | 0 | 27 |
| SSB | 307 | (270) | 37 |
| 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 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 77,98 | 81,62 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 20,24 | 15,89 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,02 | 0,21 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,12 | 0,24 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,05 | (0,09) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,24 | 0,20 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,03) | (0,05) |
| Einlagenzertifikate | 0,21 | 0,33 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,63) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Albanien | 0,11 | 0,15 |
| Angola | 0,10 | 0,33 |
| Argentinien | 4,56 | 5,45 |
| Österreich | 0,12 | 0,00 |
| Aserbaidschan | 1,49 | 1,35 |
| Bahamas | 0,34 | 0,33 |
| Brasilien | 3,44 | 3,82 |
| Cayman-Inseln | 3,62 | 2,97 |
| Chile | 2,21 | 2,09 |
| China | 1,94 | 2,44 |
| Kolumbien | 1,85 | 1,60 |
| Costa Rica | 0,44 | 0,45 |
| Dominikanische Republik | 2,79 | 2,28 |
| Ecuador | 1,28 | 0,45 |
| Ägypten | 2,30 | 1,22 |
| El Salvador | 0,28 | 0,23 |
| Gabun | 0,05 | 0,08 |
| Deutschland | 0,97 | 0,00 |
| Ghana | 1,43 | 0,66 |
| Guatemala | 1,63 | 1,18 |
| Ungarn | 0,00 | 0,02 |
| Hongkong | 0,85 | 0,95 |
| Indien | 0,94 | 1,22 |
| Indonesien | 7,50 | 7,25 |
| Irland | 1,19 | 1,76 |
| Israel | 0,61 | 0,82 |
| Elfenbeinküste | 1,06 | 0,87 |
| Jordanienien | 0,25 | 0,35 |
| Kasachstan | 0,92 | 0,60 |
| Kenia | 0,57 | 0,17 |
| Kuwait | 0,14 | 0,00 |
| Luxemburg | 2,84 | 5,41 |
| Malaysia | 0,09 | 0,00 |
| Mexiko | 7,38 | 7,81 |
| Mongolei | 0,45 | 0,53 |
| Marokko | 0,09 | 0,00 |
| Namibia | 0,05 | 0,07 |
| Niederlande | 0,43 | 0,83 |
| Nigeria | 2,00 | 1,71 |
| Oman | 1,17 | 1,42 |
| Pakistan | 0,49 | 0,30 |
| Panama | 0,93 | 1,12 |
| Paraguay | 0,22 | 0,30 |
| Peru | 1,94 | 0,80 |
| Philippinen | 0,15 | 0,21 |
| Polen | 0,10 | 0,58 |
| Katar | 2,79 | 1,09 |
| Rumänien | 0,33 | 0,03 |
| Russland | 2,48 | 0,31 |
| Saudi-Arabien | 1,80 | 1,09 |
| Senegal | 0,37 | 0,56 |
| Serbien | 0,64 | 0,95 |
| Singapur | 0,30 | 0,35 |
| Südafrika | 2,63 | 3,70 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Südkorea | 0,00 | 0,14 |
| Sri Lanka | 0,99 | 1,49 |
| Supranational | 0,08 | 0,20 |
| Tansania | 0,53 | 0,50 |
| Thailand | 0,10 | 0,22 |
| Trinidad und Tobago | 0,10 | 0,25 |
| Tunesien | 0,04 | 0,06 |
| Türkei | 6,23 | 6,83 |
| Ukraine | 2,96 | 2,34 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 1,00 | 0,31 |
| Großbritannien | 0,36 | 0,62 |
| Vereinigte Staaten | 2,82 | 3,36 |
| Uruguay | 1,39 | 1,43 |
| Venezuela | 1,12 | 1,53 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,54 | 0,08 |
| Sambia | 0,05 | 0,00 |
| Kurzfristige Instrumente | 1,94 | 0,33 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 3,34 | 7,77 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,12 | 0,24 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,02 | 0,02 |
| Zinsswaps | 0,02 | (0,11) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | 0,08 | 0,16 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,05 | (0,06) |
| Devisenterminkontrakte | (0,08) | (0,05) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,19 | 0,15 |
| Einlagenzertifikate | 0,21 | 0,33 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,03) | (0,05) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,17 | 1,65 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Akbank T.A.S.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 06.10.2019 | € | 1.600 | $ 1.817 | 0,78 |
| **Ministry of Finance of Tansania** | | | | |
| 7,741 % fällig am 10.12.2019 | $ | 800 | 806 | 0,34 |
| | | | 2.623 | 1,12 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € | 1.900 | 2.190 | 0,93 |
| **ADCB Finance Cayman Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.03.2023 | $ | 1.600 | 1.670 | 0,71 |
| **Africa Finance Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 13.04.2024 | | 1.900 | 1.928 | 0,82 |
| **African Bank Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 08.02.2020 | | 1.100 | 1.070 | 0,46 |
| 8,125 % fällig am 19.10.2020 | | 1.060 | 1.084 | 0,46 |
| **African Export-Import Bank** | | | | |
| 4,125 % fällig am 20.06.2024 | | 2.200 | 2.255 | 0,96 |
| **Akbank T.A.S.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 31.03.2025 | | 700 | 649 | 0,28 |
| **Alam Synergy Pte Ltd.** | | | | |
| 11,500 % fällig am 22.04.2021 | | 300 | 322 | 0,14 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (e)(g) | € | 400 | 479 | 0,20 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 31.01.2023 | $ | 1.177 | 1.226 | 0,52 |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 06.07.2022 (e)(g) | | 300 | 305 | 0,13 |
| **Banistmo S.A.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 19.09.2022 | | 400 | 402 | 0,17 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2024 (e)(g) | £ | 200 | 247 | 0,11 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | $ | 1.100 | 1.118 | 0,48 |
| 3,500 % fällig am 10.10.2024 | | 500 | 508 | 0,22 |
| **Burgan Tier 1 Financing Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 30.09.2019 (e)(g) | | 2.400 | 2.417 | 1,03 |
| **CBQ Finance Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 18.11.2019 | | 800 | 814 | 0,35 |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 1.000 | 967 | 0,41 |
| **China Reinsurance Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 09.03.2022 | | 1.300 | 1.300 | 0,55 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 | € | 1.000 | 1.141 | 0,49 |
| **Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance PLC** | | | | |
| 5,150 % fällig am 20.02.2024 | | 1.100 | 1.290 | 0,55 |
| **Eastern & Southern African Trade & Development Bank** | | | | |
| 4,875 % fällig am 23.05.2024 | $ | 3.100 | 3.191 | 1,36 |
| **Emaar Sukuk Ltd.** | | | | |
| 3,635 % fällig am 15.09.2026 | | 300 | 294 | 0,13 |
| **EMG SUKUK Ltd.** | | | | |
| 4,564 % fällig am 18.06.2024 | | 400 | 413 | 0,18 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 900 | 1.091 | 0,47 |
| **GLP Pte. Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 04.06.2025 | $ | 1.800 | 1.801 | 0,77 |
| **Goodman HK Finance** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.06.2024 | | 1.134 | 1.191 | 0,51 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | | 1.050 | 1.109 | 0,47 |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.** | | | | |
| 9,620 % fällig am 28.06.2018 ^ | MXN | 34.709 | 54 | 0,02 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | | |
| 3,510 % fällig am 28.06.2021 | $ | 1.800 | 1.807 | 0,77 |
| **MAF Global Securities Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 07.05.2024 | | 500 | 523 | 0,22 |
| **Multibank, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 09.11.2022 | | 1.100 | 1.128 | 0,48 |
| **NWD Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 05.10.2021 (e) | $ | 500 | $ 502 | 0,21 |
| **Poly Real Estate Finance Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 05.02.2023 | | 700 | 711 | 0,30 |
| **Promerica Financial Corp.** | | | | |
| 9,700 % fällig am 14.05.2024 | | 350 | 370 | 0,16 |
| **QNB Finansbank A/S** | | | | |
| 4,875 % fällig am 19.05.2022 | | 1.200 | 1.177 | 0,50 |
| 6,875 % fällig am 07.09.2024 | | 2.600 | 2.666 | 1,14 |
| **RKPF Overseas 2019 B Ltd.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 18.04.2021 | | 600 | 627 | 0,27 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 200 | 207 | 0,09 |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 26.03.2028 | | 1.100 | 1.183 | 0,51 |
| **SURA Asset Management S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 17.04.2024 | | 600 | 641 | 0,27 |
| **Trust F** | | | | |
| 4,869 % fällig am 15.01.2030 | | 800 | 807 | 0,34 |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 700 | 719 | 0,31 |
| 6,950 % fällig am 30.01.2044 | | 1.200 | 1.346 | 0,57 |
| **Turkiye Garanti Bankasi A/S** | | | | |
| 4,750 % fällig am 17.10.2019 | | 1.000 | 1.001 | 0,43 |
| **Turkiye Is Bankasi A/S** | | | | |
| 5,000 % fällig am 30.04.2020 | | 900 | 899 | 0,38 |
| 5,375 % fällig am 06.10.2021 | | 400 | 388 | 0,17 |
| 6,125 % fällig am 25.04.2024 | | 200 | 184 | 0,08 |
| **Unifin Financiera S.A.B. de C.V. SOFOM ENR** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.01.2025 | | 600 | 589 | 0,25 |
| **Unigel Luxemburg S.A.** | | | | |
| 10,500 % fällig am 22.01.2024 | | 1.800 | 1.935 | 0,83 |
| **United Bank for Africa PLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 08.06.2022 | | 1.100 | 1.157 | 0,49 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 23.12.2019 | | 1.200 | 1.207 | 0,52 |
| 4,071 % fällig am 25.05.2023 | | 1.300 | 1.302 | 0,56 |
| **VLL International, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 28.11.2024 | | 950 | 962 | 0,41 |
| **Woori Bank** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.04.2024 (g) | | 1.000 | 1.069 | 0,46 |
| **Yapi ve Kredi Bankasi A/S** | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.01.2020 | | 800 | 797 | 0,34 |
| 5,750 % fällig am 24.02.2022 | | 1.800 | 1.758 | 0,75 |
| | | | 60.188 | 25,69 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **ABJA Investment Co. Pte. Ltd.** | | | | |
| 5,450 % fällig am 24.01.2028 | | 1.900 | 1.823 | 0,78 |
| **Adecoagro S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 21.09.2027 | | 300 | 288 | 0,12 |
| **ADES International Holding PLC** | | | | |
| 8,625 % fällig am 24.04.2024 | | 2.300 | 2.282 | 0,97 |
| **Afren PLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 25.04.2049 ^(h) | | 10.512 | 1.310 | 0,56 |
| 6,625 % fällig am 09.12.2020 ^ | | 2.525 | 21 | 0,01 |
| 10,250 % fällig am 08.04.2019 ^ | | 607 | 5 | 0,00 |
| 11,500 % fällig am 01.02.2016 ^ | | 26.874 | 227 | 0,10 |
| **ALROSA Finance S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 09.04.2024 | | 300 | 311 | 0,13 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.05.2026 | | 2.300 | 2.317 | 0,99 |
| **Altice Finco S.A.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | | 1.000 | 964 | 0,41 |
| **Altice Luxemburg S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 | | 241 | 246 | 0,11 |
| **Andrade Gutierrez International S.A. (11,000 % bar oder 12,000 % PIK)** | | | | |
| 11,000 % fällig am 20.08.2021 (b) | | 873 | 847 | 0,36 |
| **Barminco Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2022 | | 600 | 620 | 0,27 |
| **Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.06.2034 (d) | | 3.200 | 2.168 | 0,93 |
| **Braskem America Finance Co.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 22.07.2041 | | 400 | 473 | 0,20 |
| **Braskem Finance Ltd.** | | | | |
| 6,450 % fällig am 03.02.2024 | | 1.600 | 1.772 | 0,76 |
| **Canacol Energie Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 03.05.2025 | $ | 1.900 | $ 1.985 | 0,85 |
| **Celestial Dynasty Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 27.06.2029 | | 500 | 506 | 0,22 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(b) | | 5.082 | 2.439 | 1,04 |
| **Corp. GEO S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 8,875 % fällig am 25.09.2014 ^ | | 850 | 0 | 0,00 |
| **CSN Resources S.A.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 13.02.2023 | | 2.000 | 2.117 | 0,90 |
| 7,625 % fällig am 17.04.2026 | | 600 | 638 | 0,27 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | | 700 | 731 | 0,31 |
| 5,750 % fällig am 15.11.2023 | | 100 | 105 | 0,05 |
| **Digicel Group One Ltd.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 30.12.2022 | | 926 | 519 | 0,22 |
| **Digicel Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.04.2021 | | 300 | 229 | 0,10 |
| **Eldorado Intl. Finance GmbH** | | | | |
| 8,625 % fällig am 16.06.2021 | | 700 | 736 | 0,31 |
| **Eurochem Finance DAC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 13.03.2024 | | 1.800 | 1.892 | 0,81 |
| **Evraz PLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 20.03.2023 | | 500 | 521 | 0,22 |
| **First Quantum Minerals Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.02.2021 | | 187 | 191 | 0,08 |
| **Frontera Energie Corp.** | | | | |
| 9,700 % fällig am 25.06.2023 | | 1.661 | 1.775 | 0,76 |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 07.10.2020 | | 768 | 782 | 0,33 |
| **Gran Tierra Energie, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 23.05.2027 | | 2.100 | 2.070 | 0,88 |
| **HeSteel Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.04.2020 | | 1.200 | 1.202 | 0,51 |
| **HTA Group Ltd.** | | | | |
| 9,125 % fällig am 08.03.2022 | | 1.134 | 1.194 | 0,51 |
| **IHS Niederlande Holdco BV** | | | | |
| 9,500 % fällig am 27.10.2021 | | 3.000 | 3.120 | 1,33 |
| **Indika Energie Capital Pte. Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 09.11.2024 | | 400 | 393 | 0,17 |
| **Indonesien Asahan Aluminium Persero PT** | | | | |
| 5,710 % fällig am 15.11.2023 | | 200 | 220 | 0,09 |
| **International Airport Finance S.A.** | | | | |
| 12,000 % fällig am 15.03.2033 | | 1.700 | 1.895 | 0,81 |
| **JBS Investments GmbH** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.01.2026 | | 500 | 543 | 0,23 |
| **JSL Europe S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 26.07.2024 | | 1.400 | 1.445 | 0,62 |
| **Kosmos Energie Ltd.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 04.04.2026 | | 1.900 | 1.919 | 0,82 |
| **Latam Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.08.2029 | | 1.713 | 1.738 | 0,74 |
| 4,500 % fällig am 15.08.2025 | | 1.094 | 1.089 | 0,47 |
| **Liquid Telecommunications Financing PLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 13.07.2022 | | 1.500 | 1.505 | 0,64 |
| **MARB BondCo PLC** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.03.2024 | | 590 | 617 | 0,26 |
| **Medco Oak Tree Pte Ltd.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 14.05.2026 | | 900 | 906 | 0,39 |
| **Medco Straits Services Pte. Ltd.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 17.08.2022 | | 900 | 970 | 0,41 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 600 | 598 | 0,26 |
| **Metinvest BV** | | | | |
| 7,750 % fällig am 23.04.2023 | | 3.200 | 3.316 | 1,42 |
| **MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 14.10.2022 | | 500 | 544 | 0,23 |
| **MMK International Capital DAC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 13.06.2024 | | 3.500 | 3.553 | 1,52 |
| **Mobile Telesystems OJSC via MTS International Funding Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 30.05.2023 | | 300 | 311 | 0,13 |
| **MTN Mauritius Investments Ltd.** | | | | |
| 4,755 % fällig am 11.11.2024 | | 900 | 905 | 0,39 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.09.2024 | $ | 800 | $ 802 | 0,34 |
| 4,500 % fällig am 15.06.2023 | | 400 | 411 | 0,18 |
| **OAS Restructuring BVI Ltd. (5,000 % bar und 4,750 % PIK)** | | | | |
| 5,000 % fällig am 31.03.2035 (b)(h) | BRL | 475 | 7 | 0,00 |
| **OCP S.A.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 22.10.2025 | $ | 700 | 719 | 0,31 |
| **Odebrecht Finance Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 25.04.2025 ^ | | 1.250 | 81 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 27.06.2029 ^ | | 1.500 | 103 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 26.06.2042 ^ | | 2.550 | 175 | 0,07 |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.07.2019 (d)(e) | | 1.416 | 16 | 0,01 |
| **Oil Indien Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 04.02.2029 | | 600 | 658 | 0,28 |
| **Perusahaan Gas Negara Tbk PT** | | | | |
| 5,125 % fällig am 16.05.2024 | | 400 | 431 | 0,18 |
| **Petra Diamonds U.S. Treasury PLC** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.05.2022 | | 3.000 | 2.985 | 1,27 |
| **Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC** | | | | |
| 3,949 % fällig am 24.04.2023 | | 1.500 | 1.513 | 0,65 |
| **Proven Honour Capital Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 19.05.2025 | | 500 | 507 | 0,22 |
| **Samarco Mineracao S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.11.2022 ^ | | 445 | 340 | 0,15 |
| 5,375 % fällig am 26.09.2024 ^ | | 950 | 759 | 0,32 |
| 5,750 % fällig am 24.10.2023 ^ | | 1.800 | 1.438 | 0,61 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 2.600 | 2.793 | 1,19 |
| **Sappi Papier Holding GmbH** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2026 | € | 300 | 352 | 0,15 |
| 7,500 % fällig am 15.06.2032 | $ | 1.505 | 1.528 | 0,65 |
| **SASOL Financing USA LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 27.09.2028 | | 2.800 | 3.145 | 1,34 |
| **Semiconductor Manufacturing International Corp.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 07.10.2019 | | 1.100 | 1.103 | 0,47 |
| **SEPLAT Petroleum Development Co. PLC** | | | | |
| 9,250 % fällig am 01.04.2023 | | 400 | 422 | 0,18 |
| **Severstal OAO Via Steel Capital S.A.** | | | | |
| 5,900 % fällig am 17.10.2022 | | 1.200 | 1.286 | 0,55 |
| **Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 28.01.2025 | | 300 | 316 | 0,14 |
| **Studio City Co. Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.11.2019 | | 1.200 | 1.209 | 0,52 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 11.02.2024 | | 1.200 | 1.252 | 0,53 |
| **Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 23.01.2023 | | 1.000 | 1.005 | 0,43 |
| **Suzano Österreich GmbH** | | | | |
| 7,000 % fällig am 16.03.2047 | | 1.000 | 1.140 | 0,49 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Niederlande BV** | | | | |
| 2,800 % fällig am 21.07.2023 | | 6.200 | 5.378 | 2,30 |
| **Topaz Marine S.A.** | | | | |
| 9,125 % fällig am 26.07.2022 | | 1.100 | 1.111 | 0,47 |
| **Tullow Oil PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.04.2022 | | 1.450 | 1.466 | 0,63 |
| 7,000 % fällig am 01.03.2025 | | 1.200 | 1.222 | 0,52 |
| **Turkish Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2028 | | 149 | 137 | 0,06 |
| **Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S** | | | | |
| 6,950 % fällig am 14.03.2026 | | 1.700 | 1.714 | 0,73 |
| **Vedanta Resources Finance PLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 23.04.2023 | | 1.500 | 1.523 | 0,65 |
| **Vedanta Resources Ltd.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 30.07.2022 | | 1.000 | 988 | 0,42 |
| **VTR Finance BV** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.01.2024 | | 986 | 1.024 | 0,44 |
| **WTT Investment Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 21.11.2022 | | 1.400 | 1.451 | 0,62 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 1.000 | 983 | 0,42 |
| **Yancoal International Resources Development Co. Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 13.04.2020 (e) | | 300 | 303 | 0,13 |
| **Yingde Gases Investment Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 19.01.2023 | | 1.300 | 1.323 | 0,57 |
| **YPF S.A.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 04.04.2024 | $ | 1.300 | $ 1.319 | 0,56 |
| | | | 107.331 | 45,82 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Azure Power Energie Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 03.11.2022 | | 700 | 708 | 0,30 |
| **Bharti Airtel International Niederlande BV** | | | | |
| 5,350 % fällig am 20.05.2024 | | 1.000 | 1.061 | 0,45 |
| **DTEK Finance PLC (10,750 % bar oder 10,750 % PIK)** | | | | |
| 10,750 % fällig am 31.12.2024 (b) | | 897 | 914 | 0,39 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | | 3.200 | 3.482 | 1,48 |
| **Genneia S.A.** | | | | |
| 8,750 % fällig am 20.01.2022 | | 1.200 | 1.122 | 0,48 |
| **Greenko Dutch BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 24.07.2022 | | 300 | 301 | 0,13 |
| **Indo Energie Finance BV** | | | | |
| 6,375 % fällig am 24.01.2023 | | 350 | 357 | 0,15 |
| **Minejesa Capital BV** | | | | |
| 4,625 % fällig am 10.08.2030 | | 1.700 | 1.726 | 0,74 |
| **Neerg Energie Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 13.02.2022 | | 1.300 | 1.307 | 0,56 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | | 678 | 675 | 0,29 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 (b) | | 1.035 | 644 | 0,27 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 | | 1.932 | 1.864 | 0,79 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,720 % fällig am 01.12.2026 (b) | | 1.100 | 281 | 0,12 |
| **Oi S.A. (10,000 % bar)** | | | | |
| 10,000 % fällig am 27.07.2025 (b)(h) | | 1.100 | 1.141 | 0,49 |
| **Pampa Energia S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 21.07.2023 | | 1.600 | 1.552 | 0,66 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 14.01.2025 | € | 2.200 | 2.832 | 1,21 |
| **Rio Energie S.A.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.02.2025 | $ | 2.600 | 1.984 | 0,85 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | | 2.900 | 3.263 | 1,39 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 185 | 207 | 0,09 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 543 | 625 | 0,27 |
| **Thaioil Treasury Center Co. Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 23.01.2023 | | 800 | 819 | 0,35 |
| **Turk Telekomunikasyon A/S** | | | | |
| 6,875 % fällig am 28.02.2025 | | 1.500 | 1.514 | 0,65 |
| **Yankuang Group Cayman Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.11.2020 | | 700 | 699 | 0,30 |
| | | | 29.078 | 12,41 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 196.597 | 83,92 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 1.400 | 1.531 | 0,65 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 1,875 % fällig am 31.01.2022 (i) | | 10.500 | 10.539 | 4,50 |
| 2,000 % fällig am 31.12.2021 | | 6.400 | 6.444 | 2,75 |
| | | | 18.514 | 7,90 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.10.2035 | | 1.086 | 1.090 | 0,47 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,397 % fällig am 25.08.2036 | | 790 | 748 | 0,32 |
| | | | 1.838 | 0,79 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 6,750 % fällig am 25.05.2036 | | 542 | 404 | 0,17 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 92 | 77 | 0,04 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.04.2037 | $ | 189 | $ 144 | 0,06 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | | |
| 3,054 % fällig am 25.12.2035 | | 1.100 | 1.056 | 0,45 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.09.2037 | | 261 | 255 | 0,11 |
| | | | 1.936 | 0,83 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentinien Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.03.2020 | ARS | 68 | 1 | 0,00 |
| 40,244 % fällig am 04.10.2022 | | 88 | 3 | 0,00 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | | 2.557 | 52 | 0,02 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 8.871 | 204 | 0,09 |
| **Export-Credit Bank of Türkei** | | | | |
| 8,250 % fällig am 24.01.2024 | $ | 2.500 | 2.618 | 1,12 |
| **Ghana Government International Bond** | | | | |
| 7,875 % fällig am 26.03.2027 | | 800 | 844 | 0,36 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 54,431 % fällig am 06.12.2019 (a) | ARS | 50 | 1 | 0,00 |
| **Provincia de Cordoba** | | | | |
| 7,450 % fällig am 01.09.2024 | $ | 300 | 237 | 0,10 |
| **Provincia de Entre Rios Argentinien** | | | | |
| 8,750 % fällig am 08.02.2025 | | 300 | 222 | 0,09 |
| **Provincia de Neuquen** | | | | |
| 7,500 % fällig am 27.04.2025 | | 1.000 | 845 | 0,36 |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.05.2040 | | 2.500 | 1.799 | 0,77 |
| 6,750 % fällig am 20.06.2026 | € | 1.600 | 1.935 | 0,83 |
| | | | 8.761 | 3,74 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Specialty Funds Irland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)** | | 25.272 | 294 | 0,13 |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **ENERGIE** | | | | |
| **Frontera Energie Corp.** | | 50.258 | 503 | 0,21 |
| **FINANZEN** | | | | |
| **Hipotecaria Su Casita S.A. (c)** | | 332.624 | 0 | 0,00 |
| | | | 503 | 0,21 |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | | |
| **OAS S.A. - Exp. 21.01.2039 (h)** | | 175.616 | 2 | 0,00 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (f)** | | 1.000 | 101 | 0,03 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (j)** | | | | |
| | | | 926 | 0,40 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 926 | 0,40 |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | | 14.839 | 149 | 0,06 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 232.244** | **99,13** |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 211 | $ 581 | 0,25 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 5 | 4 | 0,00 |
| | | | | $ 585 | 0,25 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 585** | **0,25** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF(1)

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag(2) | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 4.500 | $ 87 | 0,04 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,650 % | 02.01.2025 | BRL 11.000 | $ 406 | 0,17 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 | 21.06.2022 | $ 24.900 | 503 | 0,22 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 21.06.2047 | 6.100 | (477) | (0,20) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.12.2022 | 4.740 | 71 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 1.040 | (112) | (0,05) |
| | | | | | $ 391 | 0,17 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 478** | **0,21** |

(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**

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 % | 18.09.2019 | 200 | 0 $ | $ 0 | 0,00 |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag(2) | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Mexiko Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 2.000 | $ 31 | $ (31) | $ 0 | 0,00 |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | € | 2.101 | $ | 2.356 | $ 0 | $ (36) | $ (36) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 2 | ARS | 102 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 283 | | 12.652 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.312 | CNY | 9.092 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | £ | 161 | $ | 204 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 58.100 | | 533 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 12.905 | € | 11.355 | 26 | 0 | 26 | 0,01 |
| | 08/2019 | € | 11.355 | $ | 12.938 | 0 | (26) | (26) | (0,01) |
| GLM | 07/2019 | | 9.769 | | 10.902 | 0 | (223) | (223) | (0,09) |
| HUS | 07/2019 | | 50 | | 57 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 38 | ARS | 1.908 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 10.469 | $ | 1.506 | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 119 | HKD | 933 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 583 | € | 515 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 540 | ¥ | 58.100 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 58.100 | $ | 541 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 47 | $ (309) | $ (262) | (0,11) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 6.246 | CHF | 6.265 | $ 179 | $ 0 | $ 179 | 0,08 |
| BPS | 07/2019 | CHF | 79 | $ | 79 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 6.524 | | 6.663 | 0 | (29) | (29) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 6.660 | CHF | 6.672 | 183 | 0 | 183 | 0,08 |
| | 08/2019 | | 6.682 | | 6.524 | 29 | 0 | 29 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | CHF | 21 | $ | 21 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.253 | CHF | 6.294 | 202 | 0 | 202 | 0,08 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 6.577 | $ | 6.732 | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 6.702 | CHF | 6.528 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | CHF | 17 | $ | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 93 | CHF | 93 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | CHF | 29 | $ | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 609 | $ (44) | $ 565 | 0,24 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | € | 43.175 | $ | 49.064 | $ 0 | $ (104) | $ (104) | (0,05) |
| | 08/2019 | $ | 49.189 | € | 43.175 | 104 | 0 | 104 | 0,04 |
| BPS | 07/2019 | € | 40.629 | $ | 46.194 | 0 | (74) | (74) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 1.802 | € | 1.584 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 46.240 | | 40.565 | 73 | 0 | 73 | 0,03 |
| BRC | 07/2019 | | 45.879 | | 41.022 | 837 | 0 | 837 | 0,36 |
| CBK | 07/2019 | € | 43.274 | $ | 49.181 | 0 | (100) | (100) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 1.476 | € | 1.302 | 7 | (1) | 6 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 49.194 | | 43.175 | 100 | 0 | 100 | 0,04 |
| GLM | 07/2019 | | 1.128 | | 1.006 | 18 | 0 | 18 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | | 44.004 | | 39.352 | 811 | 0 | 811 | 0,35 |
| RYL | 07/2019 | | 1.088 | | 962 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 125 | $ | 141 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 848 | € | 756 | 13 | 0 | 13 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | | 222 | | 197 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 45.872 | | 41.022 | 845 | 0 | 845 | 0,36 |
| | | | | | | $ 2.821 | $ (280) | $ 2.541 | 1,08 |

Zum 30. Juni 2019 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | £ | 1.856 | $ | 2.354 | $ 0 | $ (8) | $ (8) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.358 | £ | 1.856 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | £ | 1.848 | $ | 2.348 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.301 | £ | 1.816 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.352 | | 1.848 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 47 | | 37 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 5 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 2.299 | | 1.816 | 13 | 0 | 13 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Corporate Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 07/2019 | $ 2.230 | £ 1.765 | $ 16 | $ 0 | $ 16 | 0,01 |
| | | | | $ 51 | $ (12) | $ 39 | 0,02 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 2.883** | **1,23** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **$ 236.190** | **100,82** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **$ (1.914)** | **(0,82)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **$ 234.276** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(d) Nullkuponwertpapier.**

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

**(f) Mit dem Fonds verbunden.**

**(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(h) Eingeschränkte Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|
| Afren PLC 5,000 % fällig am 25.04.2049 | 30.04.2015 | $ 10.148 | $ 1.310 | 0,56 |
| OAS Restructuring BVI Ltd. (5,000 % bar und 4,750 % PIK) 5,000 % fällig am 31.03.2035 | 16.11.2018 | 13 | 7 | 0,00 |
| OAS S.A. - Exp. 21.01.2039 | 16.11.2018 | 5 | 2 | 0,00 |
| Oi S.A. (10,000 % bar) 10,000 % fällig am 27.07.2025 | 16.05.2019 | 1.119 | 1.141 | 0,49 |
| | | $ 11.285 | $ 2.460 | 1,05 |

**(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.204 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 1.259 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 926 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (945) | $ 926 | $ 926 | 0,40 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (945)** | **$ 926** | **$ 926** | **0,40** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.047 | $ 229.018 | $ 2.179 | $ 232.244 |
| Finanzderivate[3] | 585 | 3.361 | 0 | 3.946 |
| **Summen** | **$ 1.632** | **$ 232.379** | **$ 2.179** | **$ 236.190** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 4.710 | $ 194.544 | $ 1.991 | $ 201.245 |
| Finanzderivate[3] | 636 | 617 | 0 | 1.253 |
| **Summen** | **$ 5.346** | **$ 195.161** | **$ 1.991** | **$ 202.498** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,780 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ (1.214) | $ (1.214) | (0,52) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (1.214)** | **(0,52)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 179 | $ 0 | $ 179 |
| BPS | (25) | 0 | (25) |
| BRC | 837 | (870) | (33) |
| CBK | 192 | 0 | 192 |
| GLM | (3) | 0 | (3) |
| HUS | (11) | 0 | (11) |
| JPM | 4 | 0 | 4 |
| MYI | 813 | (850) | (37) |
| RYL | 8 | 0 | 8 |
| SCX | 25 | 0 | 25 |
| SSB | 19 | 0 | 19 |
| TOR | 845 | (630) | 215 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 75,78 | 85,44 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 22,95 | 17,97 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,40 | 0,00 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,25 | 0,33 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,21 | 0,08 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,23 | 0,23 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,52) | (5,81) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 1,12 | 1,32 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 83,92 | 87,22 |
| Wandelanleihen & Wechsel | 0,00 | 0,52 |
| US-Schatzobligationen | 7,90 | 8,55 |
| Non-Agency-MBS | 0,79 | 1,03 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 0,83 | 0,99 |
| Staatsemissionen | 3,74 | 1,32 |
| Investmentfonds | 0,13 | 0,15 |
| Stammaktien | 0,21 | 0,25 |
| Optionsscheine | 0,00 | 0,00 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 0,03 | 0,05 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,40 | 0,04 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,06 | 1,97 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,25 | 0,33 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,04 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,17 | 0,08 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Devisenterminkontrakte | (0,11) | 0,01 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,34 | 0,22 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (0,82) | (4,05) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Provincia de Buenos Aires | | | | |
| 54,501 % fällig am 12.04.2025 (a) | ARS | 8.750 | $ 164 | 0,13 |
| 54,515 % fällig am 31.05.2022 (a) | | 220.730 | 4.297 | 3,34 |
| Summe Argentinien | | | 4.461 | 3,47 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Petrobras Global Finance BV | | | | |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | $ | 2.300 | 2.469 | 1,92 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| China Evergrande Group | | | | |
| 6,250 % fällig am 28.06.2021 | | 400 | 385 | 0,30 |
| 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 200 | 193 | 0,15 |
| Country Garden Holdings Co. Ltd. | | | | |
| 7,125 % fällig am 25.04.2022 | | 600 | 635 | 0,50 |
| Sunac China Holdings Ltd. | | | | |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 | | 1.300 | 1.301 | 1,01 |
| Summe Cayman Inseln | | | 2.514 | 1,96 |
| **KROATIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Hrvatska Elektroprivreda | | | | |
| 5,875 % fällig am 23.10.2022 | | 2.300 | 2.493 | 1,94 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Dominican Republic International Bond | | | | |
| 7,500 % fällig am 06.05.2021 | | 2.400 | 2.532 | 1,97 |
| **GUATEMALA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Guatemala Government International Bond | | | | |
| 5,750 % fällig am 06.06.2022 | | 2.400 | 2.560 | 1,99 |
| **HONDURAS** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Honduras Government International Bond | | | | |
| 8,750 % fällig am 16.12.2020 | | 700 | 752 | 0,59 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| ICBCIL Finance Co. Ltd. | | | | |
| 3,650 % fällig am 05.03.2022 | | 600 | 612 | 0,48 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Axis Bank Ltd. | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.06.2021 | | 600 | 598 | 0,47 |
| Shriram Transport Finance Co. Ltd. | | | | |
| 5,700 % fällig am 27.02.2022 | | 600 | 609 | 0,47 |
| State Bank of Indien | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.01.2022 | | 600 | 614 | 0,48 |
| Summe Indien | | | 1.821 | 1,42 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Indonesien Asahan Aluminium Persero PT | | | | |
| 5,230 % fällig am 15.11.2021 | | 600 | 633 | 0,49 |
| Pertamina Persero PT | | | | |
| 4,875 % fällig am 03.05.2022 | | 1.200 | 1.267 | 0,99 |
| Perusahaan Listrik Negara PT | | | | |
| 5,500 % fällig am 22.11.2021 | | 1.200 | 1.273 | 0,99 |
| Summe Indonesien | | | 3.173 | 2,47 |
| **IRLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. | | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | $ | 2.100 | $ 2.091 | 1,63 |
| MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC | | | | |
| 6,625 % fällig am 14.10.2022 | | 200 | 217 | 0,17 |
| Vnesheconombank Via VEB Finance PLC | | | | |
| 6,025 % fällig am 05.07.2022 | | 200 | 211 | 0,16 |
| | | | 2.519 | 1,96 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (d) | | 80.500 | 8.170 | 6,36 |
| Summe Irland | | | 10.689 | 8,32 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.09.2022 | $ | 200 | 204 | 0,16 |
| Sberbank of Russland Via SB Capital S.A. | | | | |
| 5,717 % fällig am 16.06.2021 | | 200 | 209 | 0,16 |
| Severstal OAO Via Steel Capital S.A. | | | | |
| 5,900 % fällig am 17.10.2022 | | 200 | 214 | 0,17 |
| Summe Luxemburg | | | 627 | 0,49 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Greenko Dutch BV | | | | |
| 4,875 % fällig am 24.07.2022 | | 600 | 601 | 0,47 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Petroleos Mexicanos | | | | |
| 5,500 % fällig am 21.01.2021 | | 1.200 | 1.216 | 0,95 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Teva Pharmaceutical Finance Niederlande BV | | | | |
| 0,375 % fällig am 25.07.2020 | € | 600 | 672 | 0,52 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Peru Government International Bond | | | | |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | PEN | 19.500 | 7.379 | 5,74 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Russland Government International Bond | | | | |
| 7,250 % fällig am 10.05.2034 | RUB | 142.200 | 2.226 | 1,73 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Telefonica Emisiones S.A. | | | | |
| 5,462 % fällig am 16.02.2021 | $ | 2.300 | 2.411 | 1,88 |
| **UKRAINE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Ukraine Government International Bond | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.05.2040 | | 6.000 | 4.318 | 3,36 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2022 | | 200 | 212 | 0,17 |
| Summe Ukraine | | | 4.530 | 3,53 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Ukraine Railways Via Shortline PLC | | | | |
| 9,875 % fällig am 15.09.2021 | | 210 | 215 | 0,17 |
| Ukreximbank Via Biz Finance PLC | | | | |
| 9,625 % fällig am 27.04.2022 | $ | 250 | $ 260 | 0,20 |
| Summe Großbritannien | | | 475 | 0,37 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| Accredited Mortgage Loan Trust | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.09.2036 | | 1.459 | 1.435 | 1,12 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Air Lease Corp. | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2022 | | 2.400 | 2.459 | 1,91 |
| Ally Financial, Inc. | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 300 | 304 | 0,24 |
| 4,625 % fällig am 19.05.2022 | | 200 | 209 | 0,16 |
| American Tower Corp. | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2022 | | 2.400 | 2.388 | 1,86 |
| AT&T, Inc. | | | | |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 2.400 | 2.422 | 1,89 |
| Broadcom, Inc. | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2021 | | 2.500 | 2.517 | 1,96 |
| CIT Group, Inc. | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 100 | 106 | 0,08 |
| Daimler Finance North America LLC | | | | |
| 3,400 % fällig am 22.02.2022 | | 2.500 | 2.552 | 1,99 |
| Dell International LLC | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 2.300 | 2.371 | 1,85 |
| DISH DBS Corp. | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | | 2.300 | 2.317 | 1,80 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | | | | |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 | | 2.300 | 2.342 | 1,82 |
| General Electric Co. | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.10.2021 | | 400 | 417 | 0,32 |
| Incitec Pivot Finance LLC | | | | |
| 6,000 % fällig am 10.12.2019 | | 2.267 | 2.297 | 1,79 |
| Kraft Heinz Foods Co. | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 2.400 | 2.457 | 1,91 |
| Marathon Oil Corp. | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.11.2022 | | 2.500 | 2.512 | 1,96 |
| MGM Resorts International | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | | 2.300 | 2.409 | 1,88 |
| Navient Corp. | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.06.2022 | | 2.300 | 2.449 | 1,91 |
| Nissan Motor Acceptance Corp. | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.01.2020 | | 2.500 | 2.496 | 1,94 |
| Reynolds American, Inc. | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.06.2020 | | 2.509 | 2.526 | 1,97 |
| Sempra Energie | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 2.400 | 2.391 | 1,86 |
| Sprint Communications, Inc. | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 2.300 | 2.389 | 1,86 |
| United Technologies Corp. | | | | |
| 3,175 % fällig am 16.08.2021 | | 2.400 | 2.402 | 1,87 |
| VMware, Inc. | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | | 2.600 | 2.622 | 2,04 |
| Zimmer Biomet Holdings, Inc. | | | | |
| 3,700 % fällig am 19.03.2023 | | 2.400 | 2.478 | 1,93 |
| | | | 49.832 | 38,80 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust | | | | |
| 2,595 % fällig am 25.08.2046 | | 130 | 124 | 0,09 |
| Summe USA | | | 51.391 | 40,01 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| Studio City Co. Ltd. | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.11.2019 | | 600 | 605 | 0,47 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (e)** | | | | |
| | | | 2.592 | 2,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| Federal Home Loan Bank | | | | |
| 2,248 % fällig am 12.07.2019 (b)(c) | $ | 400 | $ 400 | 0,31 |
| Nigeria Treasury Bills | | | | |
| 13,203 % fällig am 19.12.2019 (b)(c) | NGN | 476.000 | 1.250 | 0,97 |
| 13,853 % fällig am 14.05.2020 (b)(c) | | 800.000 | 1.998 | 1,55 |
| 13,963 % fällig am 04.06.2020 (b)(c) | | 350.000 | 868 | 0,68 |
| Pagares Portador Banco Central | | | | |
| 2,504 % fällig am 24.07.2019 (c) | CLP | 3.495.000 | 5.141 | 4,00 |
| | | | 9.657 | 7,51 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ARGENTINIEN TREASURY BILLS** | | | | |
| 2,709 % fällig am 31.07.2020 (b)(c) | ARS | 56.690 | $ 1.296 | 1,01 |
| **NIGERIA TREASURY BILLS** | | | | |
| 13,273 % fällig am 28.11.2019 (b)(c) | NGN | 793.500 | 2.102 | 1,64 |
| 13,729 % fällig am 28.05.2020 (b)(c) | | 100.000 | 249 | 0,19 |
| 13,793 % fällig am 28.05.2020 (b)(c) | | 60.000 | 149 | 0,12 |
| | | | 2.500 | 1,95 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 16.045 | 12,49 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d) | 79.884 | $ 800 | 0,63 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 123.054** | **95,81** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 32.500 | $ 492 | 0,38 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,615 % | 02.01.2025 | BRL | 7.500 | $ 52 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month PLN-WIBOR | 2,000 | 19.06.2024 | PLN | 7.100 | 4 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2021 | $ | 7.000 | 14 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | | 7.800 | 54 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | | 5.600 | 79 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2049 | | 1.800 | 54 | 0,04 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,600 | 19.06.2024 | ZAR | 45.200 | 29 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,000 | 19.06.2024 | CZK | 26.100 | 7 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 19.06.2024 | € | 1.000 | (8) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.03.2026 | | 2.400 | (33) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 1,500 | 19.06.2024 | HUF | 1.358.800 | 36 | 0,03 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,675 | 04.06.2029 | MXN | 65.100 | 28 | 0,02 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,865 | 13.05.2024 | | 56.700 | 59 | 0,05 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,385 | 01.06.2020 | | 1.086.700 | (151) | (0,12) |
| | | | | | | $ 224 | 0,18 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ 716** | **0,56** |

(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-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Türkei Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | € | 1.700 | $ (37) | $ 13 | $ (24) | (0,02) |
| CBK | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | $ | 300 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| HUS | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | | 2.000 | 4 | 4 | 8 | 0,01 |
| | Türkei Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | | 300 | (7) | 3 | (4) | 0,00 |
| JPM | Türkei Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | | 400 | (9) | 4 | (5) | (0,01) |
| | | | | | | $ (49) | $ 25 | $ (24) | (0,02) |

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

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

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (Forts.)

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt | Zahlung | Fälligkeits-datum | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR zzgl. 0,223 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 24.07.2020 | $ 1.509 | TRY 8.800 | $ 1 | $ (42) | $ (41) | (0,03) |
| DUB | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month USD-LIBOR zzgl. 0,224 % basierend auf dem Nennbetrag der erhaltenen Währung | Variabler Zinssatz entspricht 3-Month TRY-LIBOR basierend auf dem Nennbetrag der gelieferten Währung | 24.07.2020 | 1.451 | 8.500 | (6) | (41) | (47) | (0,04) |
| GLM | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR abzgl. 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 | (6) | (6) | 0,00 |
| | | | | | | $ (5) | $ (89) | $ (94) | (0,07) |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 3-Month MYR-KLIBOR | 3,520 % | 18.09.2029 | MYR 6.600 | $ 0 | $ (7) | $ (7) | (0,01) |
| BPS | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 1,890 | 18.09.2029 | THB 93.300 | 0 | 13 | 13 | 0,01 |
| CBK | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,111 | 07.06.2026 | ILS 27.300 | 0 | 21 | 21 | 0,02 |
| DUB | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 4,710 | 28.05.2022 | COP 14.640.600 | 22 | 46 | 68 | 0,05 |
| | Zahlung | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | 5,171 | 21.05.2024 | 6.053.200 | 20 | 36 | 56 | 0,05 |
| JPM | Zahlung | 6-Month CLP-CHILIBOR | 3,020 | 06.06.2024 | CLP 770.000 | 0 | 14 | 14 | 0,01 |
| | | | | | | $ 42 | $ 123 | $ 165 | 0,13 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 09/2019 | $ | 1.239 | UAH | 34.655 | $ 52 | $ 0 | $ 52 | 0,04 |
| BPS | 07/2019 | TRY | 4.432 | $ | 766 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 766 | TRY | 4.457 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | PEN | 2.942 | $ | 893 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.030 | BRL | 7.848 | 18 | 0 | 18 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 5.133 | CLP | 3.490.000 | 17 | (8) | 9 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 8.345 | PEN | 27.884 | 127 | 0 | 127 | 0,10 |
| | 07/2019 | | 1.676 | ZAR | 25.072 | 101 | 0 | 101 | 0,08 |
| | 08/2019 | € | 620 | $ | 697 | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 896 | CZK | 20.306 | 14 | 0 | 14 | 0,01 |
| | 09/2019 | CLP | 3.010.628 | $ | 4.444 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| | 09/2019 | $ | 6.172 | EGP | 105.881 | 35 | 0 | 35 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 890 | PEN | 2.942 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 568 | RON | 2.384 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 05/2020 | NGN | 151.430 | $ | 396 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | BRL | 7.848 | | 2.054 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | CLP | 3.490.000 | | 5.098 | 0 | (43) | (43) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 100 | ARS | 4.692 | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 860 | HUF | 243.768 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 2.562 | $ | 129 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.047 | BRL | 7.848 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09/2019 | TWD | 39.176 | $ | 1.252 | 0 | (15) | (15) | (0,01) |
| HUS | 07/2019 | ARS | 56.667 | | 1.268 | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 1.425 | COP | 4.708.841 | 43 | 0 | 43 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 2.504 | EGP | 43.069 | 21 | 0 | 21 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 2.504 | NGN | 912.858 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.769 | THB | 54.807 | 22 | 0 | 22 | 0,02 |
| JPM | 08/2019 | | 2.180 | MXN | 43.222 | 54 | 0 | 54 | 0,04 |
| | 09/2019 | | 4.248 | IDR | 61.426.080 | 62 | 0 | 62 | 0,05 |
| | 09/2019 | | 620 | KZT | 242.730 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| MSB | 07/2019 | | 1.861 | PLN | 7.010 | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 414 | RUB | 27.411 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| RBC | 07/2019 | COP | 4.708.841 | $ | 1.481 | 13 | 0 | 13 | 0,01 |
| | 09/2019 | $ | 1.475 | COP | 4.708.841 | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| SCX | 07/2019 | | 984 | TRY | 5.846 | 26 | 0 | 26 | 0,02 |
| UAG | 09/2019 | KRW | 1.469.761 | $ | 1.252 | 0 | (24) | (24) | (0,02) |
| | 09/2019 | $ | 1.254 | MYR | 5.212 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | | | | | | $ 691 | $ (142) | $ 549 | 0,43 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 17.616 | $ 20.018 | $ 0 | $ (42) | $ (42) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ 20.069 | € 17.616 | 43 | 0 | 43 | 0,03 |
| BRC | 07/2019 | 31.131 | 27.500 | 186 | 0 | 186 | 0,15 |
| CBK | 07/2019 | € 37.384 | $ 42.487 | 0 | (86) | (86) | (0,07) |
| | 08/2019 | $ 42.596 | € 37.384 | 86 | 0 | 86 | 0,07 |
| UAG | 07/2019 | 31.132 | 27.500 | 185 | 0 | 185 | 0,14 |
| | | | | $ 500 | $ (128) | $ 372 | 0,29 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 968** | **0,76** |
| **Summe Anlagen** | **$ 124.738** | **97,13** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ 3.699** | **2,87** |
| **Nettovermögen** | **$ 128.437** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Nullkuponwertpapier.**

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

**(d) Mit dem Fonds verbunden.**

**Barmittel in Höhe von USD 5.187 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**(e) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 1,350 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 2.592 | U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021 | $ (2.645) | $ 2.592 | $ 2.592 | 2,02 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (2.645)** | **$ 2.592** | **$ 2.592** | **2,02** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 8.970 | $ 114.084 | $ 0 | $ 123.054 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 1.684 | 0 | 1.684 |
| **Summen** | **$ 8.970** | **$ 115.768** | **$ 0** | **$ 124.738** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 22 | $ 0 | $ 22 |
| BPS | 13 | 0 | 13 |
| BRC | 186 | 0 | 186 |
| CBK | 284 | (270) | 14 |
| DUB | 77 | (80) | (3) |
| GLM | (59) | 0 | (59) |
| HUS | 82 | 0 | 82 |
| JPM | 135 | 0 | 135 |
| MSB | 36 | 0 | 36 |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| SCX | 26 | 0 | 26 |
| UAG | 167 | 0 | 167 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) [1] |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 67,33 | k. A. |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 26,46 | k. A. |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 2,02 | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,56 | k. A. |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,76 | k. A. |

[1] Der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund wurde am 4. Juni 2019 aufgelegt.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco de Galicia y Buenos Aires S.A.** | | | | |
| 25,980 % fällig am 26.04.2020 | ARS | 1.000 | $ 17 | 0,02 |
| **HSBC Bank Argentinien S.A.** | | | | |
| 25,250 % fällig am 27.09.2019 | | 3.200 | 68 | 0,10 |
| | | | 85 | 0,12 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentinien Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.03.2020 | | 160 | 5 | 0,01 |
| 40,244 % fällig am 04.10.2022 | | 620 | 22 | 0,03 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | | 4.047 | 82 | 0,12 |
| **Argentinien Treasury Bond** | | | | |
| 2,250 % fällig am 28.04.2020 | | 7.200 | 299 | 0,42 |
| **Autonomous City of Buenos Aires Argentinien** | | | | |
| 52,674 % fällig am 29.03.2024 (a) | | 7.777 | 150 | 0,21 |
| 54,688 % fällig am 22.02.2028 (a) | | 5.130 | 99 | 0,14 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 54,431 % fällig am 06.12.2019 (a) | | 200 | 5 | 0,01 |
| 54,501 % fällig am 12.04.2025 (a) | | 9.608 | 180 | 0,26 |
| 54,515 % fällig am 31.05.2022 (a) | | 3.754 | 73 | 0,10 |
| | | | 915 | 1,30 |
| Summe Argentinien | | | 1.000 | 1,42 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Commonwealth Bank of Australien** | | | | |
| 2,802 % fällig am 18.09.2020 | $ | 200 | 201 | 0,29 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco do Brasil S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 22.01.2020 | | 300 | 306 | 0,43 |
| **Centrais Eletricas Brasileiras S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 27.10.2021 | | 300 | 314 | 0,45 |
| 6,875 % fällig am 30.07.2019 | | 1.100 | 1.103 | 1,57 |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.07.2019 (c)(e) | | 23 | 0 | 0,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 300 | 322 | 0,46 |
| 8,375 % fällig am 23.05.2021 | | 342 | 378 | 0,54 |
| **Swiss Insured Brasilien Power Finance SARL** | | | | |
| 9,850 % fällig am 16.07.2032 | BRL | 5.400 | 1.543 | 2,19 |
| Summe Brasilien | | | 3.966 | 5,64 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | $ | 1.000 | 1.000 | 1,42 |
| 3,110 % fällig am 15.06.2020 | | 500 | 501 | 0,71 |
| **Glencore Finance Kanada Ltd.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.11.2021 | | 200 | 210 | 0,30 |
| Summe Kanada | | | 1.711 | 2,43 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADCB Finance Cayman Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 16.09.2019 | | 400 | 400 | 0,57 |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 200 | 193 | 0,27 |
| **KSA Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,894 % fällig am 20.04.2022 | | 400 | 405 | 0,58 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | | 17 | 17 | 0,02 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 (b) | | 45 | 28 | 0,04 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2021 | | 400 | 405 | 0,58 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | $ | 200 | $ 200 | 0,28 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 | | 300 | 308 | 0,44 |
| Summe Cayman Inseln | | | 1.956 | 2,78 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Itau CorpBanca** | | | | |
| 3,875 % fällig am 22.09.2019 | | 600 | 602 | 0,86 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of China Ltd.** | | | | |
| 0,156 % fällig am 22.11.2020 | € | 200 | 228 | 0,32 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 0,287 % fällig am 23.05.2020 | | 400 | 456 | 0,65 |
| 3,310 % fällig am 08.11.2020 | $ | 650 | 651 | 0,93 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 29.09.2019 | | 300 | 300 | 0,43 |
| 2,250 % fällig am 13.09.2020 | | 300 | 299 | 0,42 |
| 2,500 % fällig am 28.04.2020 | | 200 | 200 | 0,28 |
| **State Grid Overseas Investment Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 04.05.2022 | | 200 | 201 | 0,29 |
| Summe China | | | 2.335 | 3,32 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kolumbien Government International Bond** | | | | |
| 4,375 % fällig am 12.07.2021 | | 300 | 311 | 0,44 |
| **KROATIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Croatia Government International Bond** | | | | |
| 6,750 % fällig am 05.11.2019 | | 750 | 761 | 1,08 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Dominican Republic International Bond** | | | | |
| 7,500 % fällig am 06.05.2021 | | 267 | 281 | 0,40 |
| 8,900 % fällig am 15.02.2023 | DOP | 8.000 | 159 | 0,23 |
| 9,750 % fällig am 05.06.2026 | | 19.800 | 403 | 0,57 |
| 11,000 % fällig am 04.12.2026 | | 6.400 | 139 | 0,20 |
| Summe Dominikanische Republik | | | 982 | 1,40 |
| **ÄGYPTEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ägypten Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 29.04.2020 | $ | 300 | 305 | 0,43 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Danone S.A.** | | | | |
| 2,077 % fällig am 02.11.2021 | | 200 | 199 | 0,28 |
| **Pernod Ricard S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.04.2021 | | 200 | 211 | 0,30 |
| Summe Frankreich | | | 410 | 0,58 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 100 | 115 | 0,16 |
| 3,567 % fällig am 13.07.2020 | $ | 900 | 894 | 1,27 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 800 | 811 | 1,15 |
| 5,000 % fällig am 14.02.2022 | | 300 | 310 | 0,44 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.09.2022 | € | 200 | 242 | 0,35 |
| Summe Deutschland | | | 2.372 | 3,37 |
| **GUATEMALA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Guatemala Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 06.06.2022 | $ | 700 | 747 | 1,06 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CNOOC Finance Australien Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.05.2020 | $ | 200 | $ 201 | 0,28 |
| **Eastern Creation Investment Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.09.2020 | | 400 | 400 | 0,57 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.05.2022 | | 200 | 202 | 0,29 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 23.12.2019 | | 200 | 201 | 0,29 |
| Summe Hongkong | | | 1.004 | 1,43 |
| **UNGARN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ungarn Government International Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.08.2022 | HUF | 317.600 | 1.141 | 1,62 |
| 2,500 % fällig am 27.10.2021 | | 383.200 | 1.412 | 2,01 |
| Summe Ungarn | | | 2.553 | 3,63 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **State Bank of Indien** | | | | |
| 3,539 % fällig am 06.04.2020 | $ | 800 | 802 | 1,14 |
| 4,000 % fällig am 24.01.2022 | | 500 | 512 | 0,73 |
| Summe Indien | | | 1.314 | 1,87 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Indonesien Asahan Aluminium Persero PT** | | | | |
| 5,230 % fällig am 15.11.2021 | | 500 | 527 | 0,75 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 5,250 % fällig am 23.05.2021 | | 900 | 944 | 1,34 |
| Summe Indonesien | | | 1.471 | 2,09 |
| **IRLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € | 100 | 115 | 0,16 |
| **AerCap Irland Capital DAC** | | | | |
| 4,450 % fällig am 16.12.2021 | $ | 150 | 156 | 0,22 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | | 400 | 398 | 0,57 |
| **Russlandn Railways via RZD Capital PLC** | | | | |
| 3,450 % fällig am 06.10.2020 | | 500 | 502 | 0,71 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.07.2021 | | 200 | 200 | 0,29 |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | | 200 | 203 | 0,29 |
| | | | 1.574 | 2,24 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (f)** | | 38.212 | 3.878 | 5,51 |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Specialty Funds Irland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)** | | 31.472 | 367 | 0,52 |
| Summe Irland | | | 5.819 | 8,27 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **ISRAEL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Delek & Avner Tamar Bond Ltd.** | | | | |
| 5,082 % fällig am 30.12.2023 | $ | 400 | 412 | 0,59 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 2,701 % fällig am 16.03.2020 | | 200 | 200 | 0,29 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund
(Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **LUXEMBURG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | | |
| 3,850 % fällig am 06.02.2020 | $ | 300 | $ | 302 | 0,43 |
| 5,338 % fällig am 25.09.2020 | £ | 100 | | 133 | 0,19 |
| 5,999 % fällig am 23.01.2021 | $ | 300 | | 315 | 0,45 |
| **Sberbank of Russland Via SB Capital S.A.** | | | | | |
| 5,717 % fällig am 16.06.2021 | | 300 | | 313 | 0,44 |
| Summe Luxemburg | | | | 1.063 | 1,51 |
| **MALAYSIA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Petronas Capital Ltd.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 12.08.2019 | | 152 | | 152 | 0,22 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Malaysia Government International Bond** | | | | | |
| 4,921 % fällig am 06.07.2048 | MYR | 661 | | 176 | 0,25 |
| Summe Malaysia | | | | 328 | 0,47 |
| **MEXIKO** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.** | | | | | |
| 8,790 % fällig am 09.12.2014 ^ | MXN | 5.000 | | 0 | 0,00 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **British Transco International Finance BV** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.11.2021 (c) | $ | 100 | | 94 | 0,13 |
| **Mondelez International Holdings Niederlande BV** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.10.2021 | | 200 | | 198 | 0,28 |
| **NXP BV** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.06.2023 | | 200 | | 211 | 0,30 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | | 200 | | 202 | 0,29 |
| 3,933 % fällig am 23.04.2021 | | 200 | | 204 | 0,29 |
| **Waha Aerospace BV** | | | | | |
| 3,925 % fällig am 28.07.2020 | | 225 | | 226 | 0,32 |
| Summe Niederlande | | | | 1.135 | 1,61 |
| **PERU** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco de Credito del Peru** | | | | | |
| 4,850 % fällig am 30.10.2020 | PEN | 700 | | 214 | 0,30 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Fondo MIVIVIENDA S.A.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 14.02.2024 | | 100 | | 33 | 0,05 |
| **Peru Government International Bond** | | | | | |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 6.100 | | 2.308 | 3,28 |
| | | | | 2.341 | 3,33 |
| Summe Peru | | | | 2.555 | 3,63 |
| **KATAR** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Nakilat, Inc.** | | | | | |
| 6,067 % fällig am 31.12.2033 | $ | 100 | | 117 | 0,17 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | | |
| 5,298 % fällig am 30.09.2020 | | 167 | | 170 | 0,24 |
| 6,750 % fällig am 30.09.2019 | | 750 | | 757 | 1,07 |
| | | | | 1.044 | 1,48 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Katar Government International Bond** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.01.2022 | | 200 | | 210 | 0,30 |
| Summe Katar | | | | 1.254 | 1,78 |
| **SERBIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Serbien Government International Bond** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 25.02.2020 | | 200 | | 203 | 0,29 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **SINGAPUR** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.09.2021 | $ | 400 | $ | 396 | 0,56 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AngloGold Ashanti Holdings PLC** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.04.2020 | | 100 | | 102 | 0,15 |
| **SÜDKOREA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 13.07.2021 | | 200 | | 209 | 0,30 |
| **Korea National Oil Corp.** | | | | | |
| 2,911 % fällig am 27.03.2020 | | 200 | | 201 | 0,28 |
| Summe Südkorea | | | | 410 | 0,58 |
| **SRI LANKA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **National Savings Bank** | | | | | |
| 5,150 % fällig am 10.09.2019 | | 300 | | 300 | 0,43 |
| **TANSANIA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Tansania Government International Bond** | | | | | |
| 8,688 % fällig am 09.03.2020 | | 44 | | 45 | 0,06 |
| **TÜRKEI** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Türkei Government International Bond** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 07.11.2019 | | 350 | | 354 | 0,50 |
| **UKRAINE** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2019 | | 400 | | 402 | 0,57 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2020 | | 300 | | 310 | 0,44 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2022 | | 100 | | 106 | 0,15 |
| Summe Ukraine | | | | 818 | 1,16 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | | |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 300 | | 302 | 0,43 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | | 200 | | 202 | 0,29 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | | 504 | 0,72 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 600 | | 767 | 1,09 |
| **USA** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.12.2033 | $ | 120 | | 122 | 0,17 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.12.2036 | | 200 | | 178 | 0,25 |
| **Bayview Opportunity Master Fund Trust** | | | | | |
| 4,066 % fällig am 28.09.2033 | | 41 | | 41 | 0,06 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 3,404 % fällig am 25.10.2037 | | 22 | | 22 | 0,03 |
| 4,579 % fällig am 25.01.2035 | | 34 | | 35 | 0,05 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.07.2045 | | 10 | | 8 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.11.2037 | | 196 | | 189 | 0,27 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.02.2037 | $ | 100 | $ | 99 | 0,14 |
| 3,154 % fällig am 25.11.2035 | | 60 | | 61 | 0,09 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 2,464 % fällig am 25.11.2036 | 2 | 1 | 0,00 |
| **FBR Securitization Trust** | | | |
| 3,109 % fällig am 25.11.2035 | 400 | 390 | 0,55 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 2,494 % fällig am 25.01.2037 | 65 | 45 | 0,06 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | |
| 3,004 % fällig am 25.11.2032 | 4 | 4 | 0,01 |
| 3,754 % fällig am 25.02.2033 | 171 | 172 | 0,24 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | |
| 2,464 % fällig am 25.12.2036 | 3 | 1 | 0,00 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,464 % fällig am 25.05.2037 | 4 | 4 | 0,01 |
| 3,064 % fällig am 25.11.2035 | 193 | 189 | 0,27 |
| 3,169 % fällig am 25.01.2035 | 23 | 23 | 0,03 |
| 3,199 % fällig am 25.03.2034 | 87 | 87 | 0,12 |
| **Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust** | | | |
| 3,754 % fällig am 25.02.2033 | 32 | 32 | 0,05 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.05.2036 | 21 | 20 | 0,03 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | |
| 2,714 % fällig am 25.09.2047 | 25 | 25 | 0,04 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 2,484 % fällig am 25.06.2037 | 6 | 4 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.07.2037 | 96 | 81 | 0,12 |
| 2,584 % fällig am 25.02.2037 | 826 | 320 | 0,46 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 | 406 | 395 | 0,56 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2037 | 173 | 131 | 0,19 |
| 2,784 % fällig am 25.12.2035 | 332 | 327 | 0,46 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 2,464 % fällig am 25.10.2036 | 5 | 2 | 0,00 |
| | | 3.008 | 4,28 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Air Lease Corp.** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.03.2021 | 200 | 200 | 0,28 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | 200 | 200 | 0,28 |
| **American Electric Power Co., Inc.** | | | |
| 2,150 % fällig am 13.11.2020 | 100 | 100 | 0,14 |
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2022 | 100 | 104 | 0,15 |
| **BAT Capital Corp.** | | | |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | 500 | 501 | 0,71 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | |
| 2,750 % fällig am 15.07.2021 | 200 | 200 | 0,28 |
| **Broadcom Corp.** | | | |
| 2,200 % fällig am 15.01.2021 | 200 | 198 | 0,28 |
| **Caterpillar Financial Services Corp.** | | | |
| 2,793 % fällig am 04.09.2020 | 800 | 801 | 1,14 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | 200 | 202 | 0,29 |
| **Citigroup, Inc.** | | | |
| 3,540 % fällig am 25.04.2022 | 100 | 101 | 0,14 |
| **Comcast Corp.** | | | |
| 2,759 % fällig am 01.10.2021 | 200 | 201 | 0,29 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | |
| 3,800 % fällig am 22.10.2021 | 200 | 206 | 0,29 |
| **CVS Health Corp.** | | | |
| 3,083 % fällig am 09.03.2020 | 400 | 401 | 0,57 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | |
| 2,550 % fällig am 01.12.2020 | 100 | 100 | 0,14 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | 200 | 216 | 0,31 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | |
| 3,400 % fällig am 19.04.2021 | 300 | 305 | 0,43 |
| 3,625 % fällig am 15.03.2022 | 100 | 102 | 0,15 |
| **Duke Energie Progress LLC** | | | |
| 2,633 % fällig am 08.09.2020 | 600 | 600 | 0,85 |
| **DXC Technology Co.** | | | |
| 3,470 % fällig am 01.03.2021 | 200 | 200 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Emera U.S. Finance LP** | | | |
| 2,700 % fällig am 15.06.2021 | $ 100 | $ 100 | 0,14 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.02.2022 | 100 | 103 | 0,15 |
| 5,200 % fällig am 01.09.2020 | 100 | 103 | 0,15 |
| **Florida Gas Transmission Co. LLC** | | | |
| 5,450 % fällig am 15.07.2020 | 100 | 103 | 0,15 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 3,592 % fällig am 09.01.2020 | 400 | 401 | 0,57 |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 | 200 | 204 | 0,29 |
| **General Electric Co.** | | | |
| 2,200 % fällig am 09.01.2020 | 200 | 199 | 0,28 |
| 3,100 % fällig am 09.01.2023 | 400 | 404 | 0,58 |
| 3,450 % fällig am 15.05.2024 | 100 | 102 | 0,15 |
| 5,550 % fällig am 04.05.2020 | 200 | 205 | 0,29 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | |
| 3,442 % fällig am 09.04.2021 | 50 | 50 | 0,07 |
| 3,588 % fällig am 05.01.2023 | 100 | 99 | 0,14 |
| 3,665 % fällig am 06.11.2021 | 100 | 100 | 0,14 |
| 4,147 % fällig am 14.01.2022 | 200 | 202 | 0,29 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 3,696 % fällig am 26.04.2022 | 200 | 202 | 0,29 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2022 | 100 | 109 | 0,16 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2020 | 200 | 205 | 0,29 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.04.2021 | 100 | 103 | 0,15 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | |
| 2,926 % fällig am 26.04.2021 | 600 | 601 | 0,86 |
| **Keurig Dr Pepper, Inc.** | | | |
| 3,551 % fällig am 25.05.2021 | 200 | 204 | 0,29 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | |
| 2,800 % fällig am 02.07.2020 | 200 | 200 | 0,28 |
| **Marriott International, Inc.** | | | |
| 3,120 % fällig am 01.12.2020 | 400 | 402 | 0,57 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | |
| 3,922 % fällig am 01.06.2021 | 300 | 305 | 0,43 |
| **Mississippi Power Co.** | | | |
| 2,961 % fällig am 27.03.2020 | 200 | 200 | 0,28 |
| **NextEra Energie Capital Holdings, Inc.** | | | |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | 1.000 | 1.000 | 1,42 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | |
| 2,150 % fällig am 28.09.2020 | 100 | 99 | 0,14 |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | 100 | 100 | 0,14 |
| 2,800 % fällig am 13.01.2022 | 100 | 100 | 0,14 |
| 3,020 % fällig am 28.09.2022 | 100 | 99 | 0,14 |
| 3,150 % fällig am 15.03.2021 | 100 | 101 | 0,14 |
| 3,247 % fällig am 13.07.2022 | 100 | 100 | 0,14 |
| 3,487 % fällig am 13.01.2022 | 400 | 401 | 0,57 |
| **ONEOK, Inc.** | | | |
| 4,250 % fällig am 01.02.2022 | 100 | 103 | 0,15 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | |
| 4,250 % fällig am 17.01.2023 | 200 | 210 | 0,30 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | |
| 3,950 % fällig am 15.07.2022 | 100 | 104 | 0,15 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | |
| 3,250 % fällig am 12.06.2020 | 100 | 101 | 0,14 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | 862 | 964 | 1,37 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | 200 | 208 | 0,30 |
| **Sempra Energie** | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | 600 | 598 | 0,85 |
| **Spectra Energie Partners LP** | | | |
| 3,179 % fällig am 05.06.2020 | 400 | 401 | 0,57 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | 400 | 415 | 0,59 |
| **Sunoco Logistics Partners Operations LP** | | | |
| 4,400 % fällig am 01.04.2021 | $ 100 | $ 103 | 0,15 |
| **Wabtec Corp.** | | | |
| 3,710 % fällig am 15.09.2021 | 100 | 100 | 0,14 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | |
| 3,465 % fällig am 11.02.2022 | 100 | 101 | 0,14 |
| 3,500 % fällig am 08.03.2022 | 100 | 103 | 0,15 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | 150 | 151 | 0,22 |
| | | 5.506 | 22,04 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 4,689 % fällig am 25.07.2034 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 4,392 % fällig am 25.05.2047 ^ | 14 | 13 | 0,02 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 3,738 % fällig am 25.04.2037 | 288 | 252 | 0,36 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | |
| 3,801 % fällig am 26.12.2046 ^ | 24 | 21 | 0,03 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,474 % fällig am 25.01.2037 | 5 | 4 | 0,01 |
| 4,291 % fällig am 25.09.2037 ^ | 202 | 197 | 0,28 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 4,312 % fällig am 20.04.2035 | 3 | 3 | 0,01 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 4,518 % fällig am 25.08.2035 | 6 | 5 | 0,01 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates** | | | |
| 5,213 % fällig am 25.10.2033 | 2 | 3 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,396 % fällig am 25.01.2036 ^ | 2 | 3 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,044 % fällig am 25.07.2045 | 49 | 47 | 0,07 |
| 3,856 % fällig am 25.11.2037 | 139 | 136 | 0,19 |
| 4,290 % fällig am 25.12.2034 | 6 | 6 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 | 199 | 196 | 0,28 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 | 10 | 10 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 4,077 % fällig am 25.02.2037 ^ | 13 | 13 | 0,02 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,992 % fällig am 25.07.2036 ^ | 2 | 2 | 0,00 |
| | | 912 | 1,30 |
| Summe USA | | 9.426 | 27,62 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Rosneft Finance S.A.** | | | |
| 7,250 % fällig am 02.02.2020 | 300 | 308 | 0,44 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (h)** | | | |
| | | 187 | 0,27 |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | |
| **JPMorgan Structured Products BV** | | | |
| 17,053 % fällig am 21.11.2019 (c)(d)(g) | EGP 2.800 | 158 | 0,22 |
| **Nigeria Open Market Operation Bills** | | | |
| 13,770 % fällig am 04.06.2020 (c)(d) | NGN 50.000 | 124 | 0,18 |
| 13,945 % fällig am 06.02.2020 (c)(d) | NGN 95.500 | $ 247 | 0,35 |
| 14,199 % fällig am 23.04.2020 (c)(d) | 81,10 | 204 | 0,29 |
| 14,266 % fällig am 06.02.2020 (c)(d) | 100.000 | 258 | 0,37 |
| **Pagares Portador Banco Central** | | | |
| 2,504 % fällig am 24.07.2019 (d) | CLP 955.000 | 1.405 | 2,00 |
| | | 2.396 | 3,41 |
| **ARGENTINIEN TREASURY BILLS** | | | |
| 2,709 % fällig am 31.07.2020 (c)(d) | ARS 17.550 | 401 | 0,57 |
| 9.730 % fällig am 28.02.2020 (c)(d) | 1.000 | 23 | 0,04 |
| | | 424 | 0,61 |
| **ÄGYPTEN TREASURY BILLS** | | | |
| 17,250 % fällig am 12.05.2020 (c)(d) | EGP 11.000 | 573 | 0,81 |
| 19,207 % fällig am 24.12.2019 (c)(d) | 3.100 | 171 | 0,24 |
| 19,534 % fällig am 07.01.2020 (c)(d) | 1.600 | 88 | 0,13 |
| | | 832 | 1,18 |
| **NIGERIA TREASURY BILLS** | | | |
| 13,729 % fällig am 28.05.2020 (c)(d) | NGN 150.000 | 373 | 0,53 |
| 13,793 % fällig am 28.05.2020 (c)(d) | 75.000 | 187 | 0,26 |
| 13,798 % fällig am 28.05.2020 (c)(d) | 50.000 | 125 | 0,18 |
| 14,179 % fällig am 27.02.2020 (c)(d) | 180.100 | 461 | 0,66 |
| 16,127 % fällig am 27.02.2020 (c)(d) | 100.000 | 256 | 0,36 |
| 16,264 % fällig am 27.02.2020 (c)(d) | 50.000 | 128 | 0,18 |
| 16,324 % fällig am 27.02.2020 (c)(d) | 150.000 | 384 | 0,55 |
| 16,534 % fällig am 27.02.2020 (c)(d) | 100.000 | 256 | 0,36 |
| 17,361 % fällig am 30.01.2020 (c)(d) | 22.206 | 57 | 0,08 |
| 17,404 % fällig am 30.01.2020 (c)(d) | 20.833 | 54 | 0,08 |
| 17,514 % fällig am 30.01.2020 (c)(d) | 23.000 | 60 | 0,08 |
| | | 2.341 | 3,32 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 6.180 | 8,79 |
| | | 1.574 | 2,24 |
| | | **AKTIEN** | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | 179.835 | 1.801 | 2,56 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 68.381** | **97,22** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 37 | $ (33) | (0,05) |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

## OPTIONSKAUF

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | $ 112,000 | 23.08.2019 | 8 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 146,500 | 23.08.2019 | 37 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 1 | $ 0 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (33)** | **(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-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Deutsche Bank AG | 1,000 % | 20.12.2019 | € 100 | $ 0 | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 1.600 | $ 7 | 0,01 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,250 % | 02.01.2020 | BRL 46.000 | $ (7) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,910 | 04.01.2021 | 3.600 | (14) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,930 | 04.01.2021 | 300 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,050 | 04.01.2021 | 4.600 | 20 | 0,03 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 7,800 | 04.01.2027 | 6.100 | 35 | 0,05 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,640 | 04.01.2027 | 1.500 | (4) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,675 | 04.01.2027 | 1.700 | (28) | (0,04) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 9,600 | 04.01.2027 | 2.700 | (80) | (0,11) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 10,240 | 04.01.2027 | 1.900 | (33) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.12.2022 | $ 1.920 | 20 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 200 | (17) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 21.12.2046 | 100 | 8 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 400 | (33) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2022 | 4.800 | (92) | (0,13) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 0,755 | 03.05.2021 | HUF 503.800 | (7) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 1,090 | 15.05.2022 | 341.100 | (11) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,100 | 20.09.2020 | ¥ 1.850.000 | (16) | (0,02) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 6,240 | 01.02.2021 | MXN 6.900 | 19 | 0,03 |
| | | | | | $ (241) | (0,34) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (234)** | **(0,33)** |

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

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

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

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

## OPTIONSKAUF

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC USD versus KRW | KRW 1.290,000 | 11.07.2019 | 5.000 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |
| HUS | Call - OTC USD versus CNH | CNH 7,500 | 08.07.2019 | 6.000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 2 | $ 0 | 0,00 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs- kurs | Verfalls- datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 % | 18.09.2019 | 200 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (1) | $ 0 | 0,00 |

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | | Verfalls- datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Call - OTC USD versus TRY | TRY | 13,000 | 26.08.2020 | 300 | $ (25) | $ (5) | (0,01) |
| CBK | Call - OTC EUR versus RON | RON | 4,900 | 29.07.2019 | 700 | (3) | 0 | 0,01 |
| DUB | Call - OTC USD versus TRY | TRY | 13,000 | 27.08.2020 | 200 | (17) | (4) | (0,01) |
| FBF | Call - OTC USD versus TRY | | 13,000 | 26.08.2020 | 200 | (15) | (4) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC USD versus COP | COP | 3.490,000 | 21.08.2019 | 800 | (6) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (66) | $ (14) | (0,02) |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits- datum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Mexiko Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2019 | $ 100 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| CBK | Mexiko Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| FBF | Ägypten Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 100 | (8) | 4 | (4) | (0,01) |
| GST | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.06.2021 | 100 | (1) | (2) | (3) | 0,00 |
| HUS | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.09.2019 | 400 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | Brasilien Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 1.100 | 2 | 3 | 5 | 0,01 |
| JPM | Nigeria Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 300 | (4) | 2 | (2) | 0,00 |
| | Türkei Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 200 | (16) | 8 | (8) | (0,01) |
| NGF | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 400 | (1) | 2 | 1 | 0,00 |
| UAG | Panama Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 100 | 0 | 2 | 2 | 0,00 |
| | | | | | $ (27) | $ 19 | $ (8) | (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.

## CROSS-CURRENCY SWAPS

| Kontrahent | Erhalt | Zahlung | Fälligkeits- datum | Nennbetrag erhaltener Währung | Nennbetrag gelieferter Währung | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR abzgl. 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 | $ (4) | $ (4) | (0,01) |
| | Variabler Zinssatz entspricht 6-Month USD-LIBOR abzgl. 0,332 % 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) | (5) | (6) | (0,01) |
| | | | | | | $ (1) | $ (9) | $ (10) | (0,02) |

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits- datum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 0 | $ 1 | $ 1 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | COP | 445.524 | $ | 137 | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | TWD | 2.466 | | 78 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 935 | CLP | 634.338 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 78 | € | 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 125 | ZAR | 1.808 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 3.913 | RUB | 257.062 | 137 | 0 | 137 | 0,19 |
| | 09/2019 | | 580 | IDR | 8.401.300 | 9 | 0 | 9 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 1.002 | ILS | 3.567 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 688 | KRW | 808.675 | 12 | 0 | 12 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 5.130 | SGD | 7.022 | 66 | 0 | 66 | 0,09 |
| | 09/2019 | | 329 | TWD | 10.289 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 219 | UAH | 5.908 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 303 | KZT | 118.231 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 01/2020 | NGN | 19.306 | $ | 49 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 715 | € | 144 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | ARS | 657 | $ | 14 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 751 | | 228 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | RON | 4.154 | | 986 | 0 | (14) | (14) | (0,02) |
| | 07/2019 | TRY | 14.509 | | 2.508 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 74 | ARS | 3.725 | 11 | 0 | 11 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 162 | BRL | 623 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 7 | CLP | 4.843 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 887 | £ | 699 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 227 | PEN | 751 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.508 | TRY | 14.590 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 699 | $ | 888 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 520 | ARS | 25.702 | 53 | 0 | 53 | 0,07 |
| | 09/2019 | | 1.261 | COP | 4.259.044 | 60 | 0 | 60 | 0,09 |
| | 09/2019 | | 5.924 | KRW | 7.023.762 | 156 | 0 | 156 | 0,22 |
| | 09/2019 | | 227 | PEN | 751 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 633 | $ | 148 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 12/2019 | TRY | 4.047 | | 630 | 0 | (15) | (15) | (0,02) |
| | 03/2020 | RON | 624 | € | 126 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2020 | TRY | 612 | $ | 65 | 0 | (22) | (22) | (0,03) |
| BRC | 07/2019 | BRL | 811 | | 209 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | COP | 526.986 | | 162 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 2.638 | | 2.950 | 0 | (54) | (54) | (0,08) |
| | 07/2019 | $ | 1 | CLP | 692 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 181 | PEN | 606 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 1.809 | $ | 125 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 4.687 | | 236 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 332 | THB | 10.220 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| BSS | 07/2019 | CLP | 955.016 | $ | 1.395 | 0 | (12) | (12) | (0,02) |
| | 05/2020 | $ | 39 | ARS | 2.911 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | BRL | 508 | $ | 131 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | CLP | 794.825 | | 1.140 | 0 | (31) | (31) | (0,04) |
| | 07/2019 | COP | 333.559 | | 105 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 6.400 | | 59 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 3.633 | | 1.088 | 0 | (16) | (16) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 158 | ARS | 7.718 | 16 | 0 | 16 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 115 | CLP | 80.017 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 49 | COP | 163.464 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.368 | € | 2.087 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.054 | PEN | 3.475 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 169 | ZAR | 2.529 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| | 08/2019 | CZK | 29.305 | $ | 1.270 | 0 | (43) | (43) | (0,06) |
| | 08/2019 | € | 1.506 | | 1.716 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.177 | PEN | 3.958 | 25 | 0 | 25 | 0,04 |
| | 09/2019 | PEN | 4.160 | $ | 1.256 | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 6.372 | CNY | 44.124 | 50 | 0 | 50 | 0,07 |
| | 09/2019 | | 104 | COP | 333.559 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 570 | EGP | 10.421 | 42 | 0 | 42 | 0,06 |
| | 09/2019 | | 19 | IDR | 275.025 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 134 | UAH | 3.625 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 3.354 | MXN | 65.807 | 12 | 0 | 12 | 0,02 |
| | 10/2019 | | 479 | RON | 2.059 | 15 | 0 | 15 | 0,02 |
| | 11/2019 | | 1.059 | EGP | 19.118 | 41 | 0 | 41 | 0,06 |
| | 12/2019 | TRY | 1.738 | $ | 271 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 03/2020 | RON | 628 | € | 127 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 05/2020 | NGN | 212.949 | $ | 557 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 05/2020 | $ | 27 | ARS | 2.002 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| DUB | 07/2019 | BRL | 1.376 | $ | 354 | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 230 | ARS | 11.433 | 36 | 0 | 36 | 0,05 |
| | 07/2019 | | 404 | BRL | 1.560 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.153 | PHP | 60.094 | 17 | 0 | 17 | 0,02 |
| | 08/2020 | TRY | 395 | $ | 41 | 0 | (15) | (15) | (0,02) |
| FBF | 07/2019 | BRL | 8.365 | | 2.187 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 08/2019 | $ | 2.181 | BRL | 8.365 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 09/2019 | | 5.395 | INR | 378.757 | 38 | 0 | 38 | 0,05 |
| | 12/2019 | TRY | 1.798 | $ | 280 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 08/2020 | | 330 | | 35 | 0 | (12) | (12) | (0,02) |
| GLM | 07/2019 | CLP | 204.682 | | 290 | 0 | (12) | (12) | (0,02) |
| | 07/2019 | HUF | 255.818 | | 903 | 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | KRW | 902.733 | $ | 759 | $ 0 | $ (22) | $ (22) | (0,03) |
| | 07/2019 | TWD | 22.349 | | 707 | 0 | (14) | (14) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 230 | ARS | 10.754 | 23 | 0 | 23 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 2.181 | CLP | 1.477.860 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 07/2019 | | 168 | COP | 555.774 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| | 08/2019 | COP | 537.120 | $ | 160 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 160 | COP | 537.120 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 344 | KZT | 132.612 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 3.302 | MXN | 65.807 | 100 | 0 | 100 | 0,14 |
| | 08/2019 | | 428 | MYR | 1.800 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 765 | RUB | 50.340 | 27 | 0 | 27 | 0,04 |
| | 09/2019 | CLP | 1.477.860 | $ | 2.181 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR | 1.285.605 | | 89 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 2.316 | IDR | 33.982.151 | 67 | 0 | 67 | 0,10 |
| | 09/2019 | | 2.187 | THB | 68.291 | 44 | 0 | 44 | 0,06 |
| | 09/2019 | | 3.341 | TWD | 104.743 | 54 | 0 | 54 | 0,08 |
| | 10/2019 | MXN | 65.807 | $ | 3.266 | 0 | (100) | (100) | (0,14) |
| | 10/2019 | $ | 2.665 | MXN | 51.813 | 0 | (12) | (12) | (0,02) |
| | 10/2019 | | 404 | NGN | 150.086 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | ARS | 47.980 | $ | 1.043 | 0 | (51) | (51) | (0,07) |
| | 07/2019 | EGP | 2.015 | | 115 | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| | 07/2019 | PEN | 448 | | 134 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 11 | ARS | 549 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 409 | NGN | 148.263 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 22 | CNH | 155 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 124 | KRW | 145.953 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 134 | EGP | 2.427 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| | 01/2020 | NGN | 20.922 | $ | 53 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 06/2020 | | 46.560 | | 121 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| IND | 09/2019 | $ | 683 | MYR | 2.843 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| JPM | 07/2019 | BRL | 593 | $ | 148 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 07/2019 | CLP | 162.132 | | 229 | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| | 07/2019 | HUF | 7.081 | | 26 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | KRW | 36.862 | | 31 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 623 | € | 551 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.325 | ZAR | 19.299 | 42 | 0 | 42 | 0,06 |
| | 09/2019 | IDR | 1.920.520 | $ | 133 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 64 | EGP | 1.147 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 742 | PHP | 38.836 | 14 | 0 | 14 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 556 | THB | 17.118 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 227 | TRY | 1.765 | 65 | 0 | 65 | 0,09 |
| | 09/2019 | | 387 | TWD | 12.113 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| | 01/2020 | NGN | 21.213 | $ | 54 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 02/2020 | | 94.570 | | 250 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 05/2020 | | 46.598 | | 122 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | $ | 788 | TWD | 24.815 | 12 | 0 | 12 | 0,02 |
| | 08/2019 | MYR | 1.800 | $ | 442 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| | 09/2019 | TWD | 19.023 | | 606 | 0 | (11) | (11) | (0,02) |
| | 09/2019 | $ | 110 | INR | 7.733 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 24.815 | $ | 790 | 0 | (16) | (16) | (0,02) |
| | 03/2020 | RON | 629 | € | 127 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | ZAR | 2.469 | $ | 169 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| RBC | 07/2019 | CLP | 705 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 185 | COP | 586.831 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | COP | 586.831 | $ | 184 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | $ | 211 | CLP | 146.054 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| SCX | 07/2019 | £ | 699 | $ | 885 | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 2.349 | BRL | 9.470 | 122 | 0 | 122 | 0,17 |
| | 07/2019 | | 795 | KRW | 939.595 | 18 | 0 | 18 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 374 | RUB | 24.832 | 19 | 0 | 19 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 3.223 | TRY | 19.138 | 84 | 0 | 84 | 0,12 |
| | 08/2019 | | 3.889 | CZK | 89.041 | 100 | 0 | 100 | 0,14 |
| | 09/2019 | KRW | 939.595 | $ | 797 | 0 | (18) | (18) | (0,02) |
| | 09/2019 | $ | 52 | EGP | 931 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 383 | THB | 11.779 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | | 5.643 | PLN | 21.244 | 56 | 0 | 56 | 0,08 |
| TOR | 08/2019 | MXN | 4.895 | $ | 253 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | CLP | 226.444 | | 324 | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 8 | € | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 59 | ¥ | 6.400 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 6.400 | $ | 60 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 2.143 | MYR | 8.908 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| | 10/2019 | | 316 | RON | 1.339 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| | | | | | | $ 1.807 | $ (638) | $ 1.169 | 1,66 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 1.138** | **1,61** |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 2,980 % fällig am 25.10.2019 | $ 200 | $ 200 | 0,29 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 200** | **0,29** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 69.452** | **98,74** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 884** | **1,26** |
| **Nettovermögen** | | **$ 70.336** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(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) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| JPMorgan Structured Products BV | 17,053 % | 21.11.2019 | 21.02.2019 | $ 150 | $ 158 | 0,22 |

**Barmittel in Höhe von USD 292 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 1,350 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 187 | U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021 | $ (192) | $ 187 | $ 187 | 0,27 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (192)** | **$ 187** | **$ 187** | **0,27** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 6.046 | $ 62.335 | $ 0 | $ 68.381 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 200 | 0 | 200 |
| Finanzderivate[3] | (33) | 904 | 0 | 871 |
| **Summen** | **$ 6.013** | **$ 63.439** | **$ 0** | **$ 69.452** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 4.979 | $ 45.647 | $ 0 | $ 50.626 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 200 | 0 | 200 |
| Finanzderivate[3] | 23 | (54) | 0 | (31) |
| **Summen** | **$ 5.002** | **$ 45.793** | **$ 0** | **$ 50.795** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 225 | $ 0 | $ 225 |
| BPS | 218 | (320) | (102) |
| BRC | (63) | 0 | (63) |
| BSS | (4) | 0 | (4) |
| CBK | 120 | 0 | 120 |
| DUB | 32 | (40) | (8) |
| FBF | 12 | 0 | 12 |
| GLM | 163 | 0 | 163 |
| GST | (3) | 0 | (3) |
| HUS | (46) | 0 | (46) |
| IND | 4 | 0 | 4 |
| JPM | 102 | 0 | 102 |
| MSB | (10) | 0 | (10) |
| MYI | (6) | 0 | (6) |
| NGF | 1 | 0 | 1 |
| RYL | 4 | 0 | 4 |
| SCX | 325 | (290) | 35 |
| SOG | 56 | 0 | 56 |
| UAG | 8 | 0 | 8 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 63,75 | 65,42 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 33,20 | 31,12 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,27 | 1,20 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,05) | 0,04 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,33) | (0,01) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,61 | (0,10) |
| Einlagenzertifikate | 0,29 | 0,39 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 1,42 | 1,46 |
| Australien | 0,29 | 0,39 |
| Bermuda | 0,00 | 0,39 |
| Brasilien | 5,64 | 1,54 |
| Kanada | 2,43 | 2,89 |
| Cayman-Inseln | 2,78 | 1,81 |
| Chile | 0,86 | 0,00 |
| China | 3,32 | 3,05 |
| Kolumbien | 0,44 | 0,00 |
| Kroatien | 1,08 | 0,69 |
| Dominikanische Republik | 1,40 | 0,00 |
| Ägypten | 0,43 | 0,00 |
| Frankreich | 0,58 | 0,00 |
| Deutschland | 3,37 | 1,13 |
| Griechenland | 0,00 | 0,89 |
| Guatemala | 1,06 | 0,00 |
| Hongkong | 1,43 | 1,14 |
| Ungarn | 3,63 | 0,00 |
| Indien | 1,87 | 2,51 |
| Indonesien | 2,09 | 3,55 |
| Irland | 8,27 | 7,40 |
| Israel | 0,59 | 0,39 |
| Japan | 0,29 | 0,58 |
| Luxemburg | 1,51 | 3,62 |
| Malaysia | 0,47 | 0,69 |
| Mexiko | 0,00 | 1,09 |
| Niederlande | 1,61 | 1,35 |
| Peru | 3,63 | 0,46 |
| Katar | 1,78 | 1,53 |
| Serbien | 0,29 | 0,39 |
| Singapur | 0,56 | 0,87 |
| Südafrika | 0,15 | 0,20 |
| Südkorea | 0,58 | 0,39 |
| Sri Lanka | 0,43 | 1,34 |
| Tansania | 0,06 | 0,13 |
| Thailand | 0,00 | 0,39 |
| Türkei | 0,50 | 2,62 |
| Ukraine | 1,16 | 0,37 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,72 | 0,38 |
| Großbritannien | 1,09 | 0,00 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Vereinigte Staaten | 27,62 | 12,53 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,44 | 0,77 |
| Kurzfristige Instrumente | 8,79 | 35,42 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 2,56 | 3,39 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,05) | 0,04 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,34) | (0,01) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | (0,02) | (0,03) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | 0,01 |
| Cross-Currency Swaps | (0,02) | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 1,66 | (0,08) |
| Einlagenzertifikate | 0,29 | 0,39 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 1,26 | 1,94 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 4,154 % fällig am 25.10.2023 | $ | 214 | € 189 | 0,01 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2027 | € | 5.000 | 5.006 | 0,20 |
| | | | 5.195 | 0,21 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 0,080 % fällig am 03.12.2021 | | 6.200 | 6.238 | 0,25 |
| 2,450 % fällig am 04.06.2020 | $ | 1.300 | 1.143 | 0,05 |
| **Aircastle Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.03.2021 | | 500 | 456 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2022 | | 400 | 372 | 0,01 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 400 | 352 | 0,01 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 400 | 356 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2020 | | 400 | 365 | 0,01 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2022 | | 300 | 262 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 15.09.2021 | | 100 | 90 | 0,00 |
| 5,900 % fällig am 01.11.2021 | | 1.200 | 1.134 | 0,05 |
| **Annington Funding PLC** | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.07.2024 | € | 1.100 | 1.129 | 0,04 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.07.2024 | | 700 | 731 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 02.11.2026 | | 300 | 316 | 0,01 |
| 2,125 % fällig am 13.03.2023 | | 700 | 746 | 0,03 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | | 3.300 | 3.555 | 0,14 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h) | | 1.200 | 1.244 | 0,05 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (f)(h) | | 1.600 | 1.686 | 0,07 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,389 % fällig am 25.04.2024 | | 900 | 905 | 0,04 |
| 0,471 % fällig am 04.05.2023 | | 700 | 705 | 0,03 |
| 0,532 % fällig am 14.09.2020 | | 1.500 | 1.513 | 0,06 |
| 2,500 % fällig am 27.07.2020 | | 1.200 | 1.234 | 0,05 |
| **Bank of Irland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (f)(h) | | 1.200 | 1.269 | 0,05 |
| **Bank of Irland Group PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 29.08.2023 | | 4.300 | 4.398 | 0,18 |
| **Bank of Montreal** | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.09.2022 | | 8.200 | 8.484 | 0,34 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | $ | 5.000 | 4.797 | 0,19 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 3,200 % fällig am 10.08.2021 | | 1.200 | 1.062 | 0,04 |
| 4,655 % fällig am 10.08.2021 | | 5.800 | 5.207 | 0,21 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | € | 1.700 | 1.721 | 0,07 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | £ | 3.400 | 3.837 | 0,15 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (f)(h) | € | 3.200 | 3.468 | 0,14 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | | 2.600 | 2.750 | 0,11 |
| **BNG Bank NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 26.08.2022 | | 5.000 | 5.156 | 0,21 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 13.06.2024 (f)(h) | | 2.000 | 2.165 | 0,09 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 3,162 % fällig am 23.07.2021 | $ | 600 | 528 | 0,02 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 26.10.2023 | € | 1.100 | 1.126 | 0,04 |
| 1,500 % fällig am 24.07.2026 | | 1.700 | 1.789 | 0,07 |
| 2,700 % fällig am 27.10.2022 | $ | 2.500 | 2.215 | 0,09 |
| **CNH Industrial Capital LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 06.11.2020 | | 100 | 90 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 01.04.2021 | | 600 | 546 | 0,02 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 4,125 % fällig am 14.01.2020 | € | 3.400 | 3.482 | 0,14 |
| 4,625 % fällig am 29.12.2025 (f)(h) | | 3.800 | 4.083 | 0,16 |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (f)(h) | | 400 | 417 | 0,02 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (f)(h) | € | 4.400 | € 4.880 | 0,20 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 (h) | | 1.200 | 1.260 | 0,05 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | | 900 | 914 | 0,04 |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | | 2.000 | 2.051 | 0,08 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 1,000 % fällig am 07.06.2023 | | 1.300 | 1.351 | 0,05 |
| 1,125 % fällig am 15.09.2020 | | 1.200 | 1.220 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | $ | 2.600 | 2.519 | 0,10 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (f)(h) | | 7.300 | 6.896 | 0,28 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h) | | 2.200 | 2.065 | 0,08 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,180 % fällig am 07.12.2020 | € | 2.000 | 1.977 | 0,08 |
| 1,250 % fällig am 08.09.2021 | | 1.900 | 1.903 | 0,08 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 7.200 | 7.262 | 0,29 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | $ | 3.600 | 3.206 | 0,13 |
| **Deutsche Hypothekenbank AG** | | | | |
| 1,043 % fällig am 22.03.2021 | £ | 6.600 | 7.373 | 0,30 |
| **Deutsche Pfandbriefbank AG** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.08.2019 | $ | 1.600 | 1.404 | 0,06 |
| 2,250 % fällig am 04.05.2020 | | 6.800 | 5.968 | 0,24 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.05.2024 (c) | € | 7.600 | 7.675 | 0,31 |
| 0,250 % fällig am 19.03.2020 | | 16.300 | 16.382 | 0,66 |
| 0,250 % fällig am 02.06.2022 | | 3.000 | 3.054 | 0,12 |
| 0,250 % fällig am 01.06.2023 | | 2.000 | 2.043 | 0,08 |
| 0,500 % fällig am 17.01.2025 | | 3.500 | 3.626 | 0,14 |
| 2,000 % fällig am 22.01.2021 | | 1.800 | 1.870 | 0,07 |
| **DNB Bank ASA** | | | | |
| 2,375 % fällig am 02.06.2021 | $ | 3.300 | 2.904 | 0,12 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (c) | € | 1.700 | 1.647 | 0,07 |
| **Euroclear Bank S.A.** | | | | |
| 0,040 % fällig am 10.07.2020 | | 2.300 | 2.306 | 0,09 |
| 0,077 % fällig am 08.03.2021 | | 4.800 | 4.819 | 0,19 |
| **EUROFIMA** | | | | |
| 0,625 % fällig am 30.06.2021 | CHF | 7.200 | 6.661 | 0,27 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | |
| 0,125 % fällig am 17.10.2023 | € | 17.200 | 17.627 | 0,71 |
| 0,400 % fällig am 17.02.2025 | | 5.200 | 5.411 | 0,22 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.04.2025 | | 9.500 | 9.693 | 0,39 |
| 0,625 % fällig am 22.01.2029 | | 1.300 | 1.382 | 0,05 |
| **Europäischer Stabilitätsmechanismus** | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.01.2022 (c) | | 7.300 | 7.403 | 0,30 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | | 2.400 | 2.576 | 0,10 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 24.06.2021 | | 1.100 | 1.126 | 0,04 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.02.2020 | $ | 1.600 | 1.402 | 0,06 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,157 % fällig am 04.08.2020 | | 600 | 529 | 0,02 |
| 3,484 % fällig am 12.10.2021 | | 1.200 | 1.038 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2021 | | 1.600 | 1.463 | 0,06 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 0,207 % fällig am 26.03.2022 | € | 300 | 296 | 0,01 |
| 0,372 % fällig am 10.05.2021 | | 800 | 803 | 0,03 |
| 3,200 % fällig am 13.07.2020 | $ | 100 | 88 | 0,00 |
| 3,700 % fällig am 24.11.2020 | | 100 | 89 | 0,00 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,132 % fällig am 16.12.2020 | € | 5.700 | 5.706 | 0,23 |
| 0,307 % fällig am 09.09.2022 | | 7.500 | 7.523 | 0,30 |
| 0,389 % fällig am 29.05.2020 | | 600 | 603 | 0,02 |
| 3,752 % fällig am 23.04.2020 | $ | 2.800 | 2.475 | 0,10 |
| **HSBC Frankreich S.A.** | | | | |
| 0,200 % fällig am 04.09.2021 | € | 5.500 | 5.542 | 0,22 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 0,578 % fällig am 04.12.2021 | | 4.900 | 4.940 | 0,20 |
| 6,250 % fällig am 23.03.2023 (f)(h) | $ | 2.400 | 2.172 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 20.05.2024 | £ | 1.800 | 2.441 | 0,10 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 0,110 % fällig am 26.11.2021 | € | 7.500 | 7.552 | 0,30 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 18.05.2028 | | 3.800 | 4.030 | 0,16 |
| 2,500 % fällig am 25.06.2029 | | 1.700 | 1.867 | 0,07 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 26.10.2022 | € | 800 | € 840 | 0,03 |
| 2,550 % fällig am 29.10.2020 | $ | 1.300 | 1.145 | 0,05 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 0,375 % fällig am 01.07.2024 | € | 800 | 822 | 0,03 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK | 73.600 | 9.901 | 0,40 |
| 1,000 % fällig am 01.01.2020 | | 77.300 | 10.450 | 0,42 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 11.489 | 1.598 | 0,06 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 94.200 | 12.891 | 0,52 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 166.950 | 23.056 | 0,92 |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (f)(h) | € | 1.400 | 1.374 | 0,05 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 2,125 % fällig am 21.10.2020 | $ | 1.400 | 1.224 | 0,05 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.04.2024 (c) | € | 4.600 | 4.699 | 0,19 |
| 0,000 % fällig am 04.07.2024 (c) | | 9.700 | 9.904 | 0,40 |
| 5,000 % fällig am 19.03.2024 | AUD | 200 | 143 | 0,01 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 24.05.2021 | € | 5.600 | 5.705 | 0,23 |
| 1,000 % fällig am 02.05.2023 | | 300 | 305 | 0,01 |
| **Liberty Mutual Group, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 04.05.2026 | | 400 | 443 | 0,02 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | £ | 4.000 | 5.572 | 0,22 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (f)(h) | | 400 | 488 | 0,02 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.04.2021 | € | 7.200 | 7.263 | 0,29 |
| **Merlin Properties Socimi S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 23.05.2022 | | 3.000 | 3.179 | 0,13 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.03.2021 | $ | 1.035 | 918 | 0,04 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,087 % fällig am 21.05.2021 | € | 10.150 | 10.166 | 0,41 |
| 0,392 % fällig am 08.11.2022 | | 9.100 | 9.141 | 0,37 |
| 5,375 % fällig am 10.08.2020 | | 2.800 | 2.972 | 0,12 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | |
| 0,080 % fällig am 02.03.2020 | | 14.460 | 14.474 | 0,58 |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | | 2.000 | 2.011 | 0,08 |
| 5,375 % fällig am 30.09.2019 | | 1.500 | 1.521 | 0,06 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | $ | 500 | 456 | 0,02 |
| **New York Life Global Funding** | | | | |
| 2,900 % fällig am 17.01.2024 | | 5.000 | 4.497 | 0,18 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 3,177 % fällig am 13.01.2020 | | 6.700 | 5.892 | 0,24 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (f) | € | 400 | 443 | 0,02 |
| **NORD/LB Luxemburg S.A. Covered Bond Bank** | | | | |
| 2,875 % fällig am 16.02.2021 | $ | 7.200 | 6.394 | 0,26 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.01.2020 | DKK | 3.700 | 500 | 0,02 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 4.900 | 672 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 49.958 | 6.904 | 0,28 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 2 | 0 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,156 % fällig am 01.10.2022 | € | 9.300 | 9.417 | 0,38 |
| 1,000 % fällig am 01.01.2020 | DKK | 150.700 | 20.360 | 0,82 |
| 1,000 % fällig am 01.04.2020 | | 431.000 | 58.444 | 2,34 |
| 1,000 % fällig am 01.07.2020 | | 200 | 27 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.01.2023 | € | 3.500 | 3.646 | 0,15 |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 14.300 | 1.891 | 0,08 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 9.857 | 1.371 | 0,05 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2047 | | 27 | 4 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 234.022 | 31.933 | 1,28 |
| 2,000 % fällig am 01.01.2020 | € | 5.400 | 5.470 | 0,22 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 355.029 | 49.054 | 1,97 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 1.839 | 261 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 209 | 29 | 0,00 |
| **PKO Bank Hipoteczny S.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 23.11.2021 | € | 3.600 | 3.636 | 0,15 |
| **Pricoa Global Funding** | | | | |
| 2,200 % fällig am 03.06.2021 | $ | 3.100 | 2.721 | 0,11 |
| **Prologis LP** | | | | |
| 1,375 % fällig am 13.05.2021 | € | 1.100 | 1.127 | 0,04 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **QNB Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,872 % fällig am 31.05.2021 | $ | 4.650 | € | 4.140 | 0,17 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.01.2020 | DKK | 2.300 | | 311 | 0,01 |
| 1,000 % fällig am 01.04.2020 | | 5.000 | | 678 | 0,03 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2047 | | 469 | | 64 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 114.544 | | 15.811 | 0,63 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2036 | | 8 | | 1 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | | 70 | | 10 | 0,00 |
| **Royal Bank of Kanada** | | | | | |
| 0,121 % fällig am 06.08.2020 | € | 2.500 | | 2.510 | 0,10 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | | 1.400 | | 1.488 | 0,06 |
| **Santander UK Group Holdings PLC (h)** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | $ | 600 | | 548 | 0,02 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.07.2021 | | 200 | | 176 | 0,01 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 19.02.2021 | € | 5.100 | | 5.180 | 0,21 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.10.2021 | $ | 400 | | 385 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | | |
| 0,156 % fällig am 25.09.2020 | € | 1.200 | | 1.206 | 0,05 |
| **Temasek Financial Ltd.** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.03.2022 | | 1.000 | | 1.020 | 0,04 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 0,190 % fällig am 10.01.2020 | | 400 | | 401 | 0,02 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | $ | 1.950 | | 1.921 | 0,08 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | | |
| 0,378 % fällig am 20.09.2022 | € | 500 | | 503 | 0,02 |
| 1,250 % fällig am 17.04.2025 | | 1.600 | | 1.663 | 0,07 |
| 2,950 % fällig am 24.09.2020 | $ | 2.900 | | 2.564 | 0,10 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 2.400 | | 2.251 | 0,09 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | | |
| 0,102 % fällig am 15.06.2021 | € | 600 | | 599 | 0,02 |
| 0,377 % fällig am 08.12.2021 | | 1.700 | | 1.706 | 0,07 |
| 0,625 % fällig am 08.09.2021 | | 1.000 | | 1.010 | 0,04 |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 2.000 | | 2.098 | 0,08 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | | |
| 0,040 % fällig am 11.10.2019 | | 3.400 | | 3.402 | 0,14 |
| 0,250 % fällig am 16.10.2020 | | 10.200 | | 10.235 | 0,41 |
| 0,489 % fällig am 15.02.2021 | | 2.600 | | 2.615 | 0,10 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 16.02.2021 | | 5.800 | | 5.819 | 0,23 |
| 1,000 % fällig am 16.02.2023 | | 700 | | 712 | 0,03 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 30.03.2020 | | 1.200 | | 1.209 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 02.10.2023 | $ | 500 | | 466 | 0,02 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 02.06.2020 | € | 1.500 | | 1.504 | 0,06 |
| 2,600 % fällig am 22.07.2020 | $ | 900 | | 793 | 0,03 |
| 3,465 % fällig am 11.02.2022 | | 900 | | 795 | 0,03 |
| 3,691 % fällig am 24.01.2023 | | 3.400 | | 3.023 | 0,12 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | | | |
| 3,092 % fällig am 23.07.2021 | | 1.800 | | 1.583 | 0,06 |
| | | | | 721.889 | 28,94 |

## INDUSTRIEWERTE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Abbott Irland Financing DAC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 27.09.2020 (c) | € | 3.800 | | 3.806 | 0,15 |
| **AbbVie, Inc.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.11.2021 | $ | 1.300 | | 1.161 | 0,05 |
| **Allergan Funding SCS** | | | | | |
| 0,039 % fällig am 15.11.2020 | € | 7.000 | | 6.998 | 0,28 |
| **Allergan Sales LLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2021 | $ | 100 | | 92 | 0,00 |
| **Arrow Electronics, Inc.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2022 | | 700 | | 625 | 0,03 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2023 | € | 1.000 | | 1.070 | 0,04 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | | |
| 2,297 % fällig am 14.08.2020 | $ | 1.800 | | 1.578 | 0,06 |
| 2,764 % fällig am 15.08.2022 | | 100 | | 88 | 0,00 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 07.07.2020 | € | 8.500 | | 8.852 | 0,36 |
| **Bayer AG** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 25.01.2021 | | 3.500 | | 3.588 | 0,14 |
| **Bayer Capital Corp. BV** | | | | | |
| 0,207 % fällig am 26.06.2022 | € | 3.800 | | 3.787 | 0,15 |
| **Becton Dickinson and Co.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2020 | $ | 100 | | 89 | 0,00 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | | |
| 3,040 % fällig am 15.03.2021 | | 200 | | 175 | 0,01 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 500 | | 461 | 0,02 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | | |
| 3,800 % fällig am 22.10.2021 | | 2.100 | | 1.896 | 0,08 |
| **CRH Finland Services OYJ** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.10.2020 | € | 3.250 | | 3.348 | 0,13 |
| **CVS Health Corp.** | | | | | |
| 3,083 % fällig am 09.03.2020 | $ | 1.600 | | 1.409 | 0,06 |
| 3,173 % fällig am 09.03.2021 | | 1.000 | | 882 | 0,04 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | | |
| 2,200 % fällig am 30.10.2021 | | 150 | | 130 | 0,01 |
| 3,350 % fällig am 04.05.2021 | | 300 | | 267 | 0,01 |
| **Daimler International Finance BV** | | | | | |
| 0,292 % fällig am 13.11.2019 | € | 1.800 | | 1.803 | 0,07 |
| **Danone S.A.** | | | | | |
| 1,691 % fällig am 30.10.2019 | $ | 200 | | 175 | 0,01 |
| 2,077 % fällig am 02.11.2021 | | 200 | | 175 | 0,01 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 500 | | 453 | 0,02 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | | |
| 2,600 % fällig am 04.12.2020 | | 500 | | 439 | 0,02 |
| 3,625 % fällig am 15.03.2022 | | 500 | | 447 | 0,02 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | | |
| 1,950 % fällig am 19.09.2021 | | 1.800 | | 1.565 | 0,06 |
| 2,125 % fällig am 18.01.2021 | € | 2.000 | | 2.072 | 0,08 |
| 2,225 % fällig am 17.01.2020 | $ | 700 | | 613 | 0,03 |
| **Diageo Finance PLC** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 22.10.2021 | € | 600 | | 606 | 0,02 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | $ | 800 | | 707 | 0,03 |
| **eBay, Inc.** | | | | | |
| 3,800 % fällig am 09.03.2022 | | 500 | | 455 | 0,02 |
| **EMC Corp.** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 600 | | 524 | 0,02 |
| **EMD Finance LLC** | | | | | |
| 2,400 % fällig am 19.03.2020 | | 100 | | 88 | 0,00 |
| **Energie Transfer Operating LP** | | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | | 300 | | 268 | 0,01 |
| **Equifax, Inc.** | | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.08.2021 | | 200 | | 179 | 0,01 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | | |
| 2,350 % fällig am 15.10.2019 | | 600 | | 526 | 0,02 |
| **Essity AB** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 26.05.2021 | € | 5.600 | | 5.666 | 0,23 |
| **Evonik Finance BV** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.03.2021 (c) | | 6.200 | | 6.215 | 0,25 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 21.05.2021 | | 2.300 | | 2.310 | 0,09 |
| **Florida Gas Transmission Co. LLC** | | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.07.2020 | $ | 100 | | 90 | 0,00 |
| **Fortune Brands Home & Security, Inc.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2020 | | 400 | | 352 | 0,01 |
| **Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.10.2020 | | 100 | | 89 | 0,00 |
| **G4S International Finance PLC** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 09.01.2023 | € | 200 | | 204 | 0,01 |
| **General Electric Co.** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 17.05.2025 | | 800 | | 798 | 0,03 |
| **Holcim U.S. Finance SARL & Cie SCS** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 30.12.2019 | $ | 300 | | 267 | 0,01 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.07.2020 | | 900 | | 793 | 0,03 |
| 3,375 % fällig am 26.02.2026 | € | 800 | | 906 | 0,04 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 25.09.2021 | | 1.200 | | 1.215 | 0,05 |
| **Interpublic Group of Cos., Inc.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2022 | $ | 400 | | 363 | 0,02 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.09.2025 | € | 2.100 | | 2.185 | 0,09 |
| 3,250 % fällig am 15.03.2025 | | 800 | | 827 | 0,03 |
| **Japan Tobacco, Inc.** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 13.04.2021 | $ | 600 | € | 522 | 0,02 |
| **Keurig Dr Pepper, Inc.** | | | | | |
| 2,530 % fällig am 15.11.2021 | | 1.000 | | 877 | 0,04 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | | | |
| 2,118 % fällig am 11.09.2020 | | 400 | | 350 | 0,01 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 02.07.2020 | | 1.200 | | 1.055 | 0,04 |
| 3,115 % fällig am 10.02.2021 | | 1.100 | | 964 | 0,04 |
| **MGM Resorts International** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | | 500 | | 460 | 0,02 |
| **Molnlycke Holding AB** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 28.02.2024 | € | 400 | | 422 | 0,02 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2025 | | 400 | | 423 | 0,02 |
| **Molson Coors Brewing Co.** | | | | | |
| 2,100 % fällig am 15.07.2021 | $ | 200 | | 174 | 0,01 |
| **Mondelez International Holdings Niederlande BV** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.10.2021 | | 400 | | 348 | 0,01 |
| **Mylan NV** | | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.06.2021 | | 500 | | 439 | 0,02 |
| **Newcrest Finance Pty. Ltd.** | | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.11.2021 | | 100 | | 91 | 0,00 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | | |
| 1,900 % fällig am 21.07.2021 | | 500 | | 435 | 0,02 |
| **Owens Corning** | | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.07.2047 | | 622 | | 462 | 0,02 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.07.2020 | | 400 | | 353 | 0,01 |
| 3,375 % fällig am 01.02.2022 | | 400 | | 358 | 0,02 |
| **Pernod Ricard S.A.** | | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.01.2022 | | 350 | | 322 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 07.04.2021 | | 750 | | 696 | 0,03 |
| **Philip Morris International, Inc.** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 02.11.2022 | | 300 | | 265 | 0,01 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.01.2020 | | 100 | | 90 | 0,00 |
| **ProSiebenSat.1 Media SE** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2021 | € | 500 | | 518 | 0,02 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2019 | $ | 1.200 | | 1.063 | 0,04 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.06.2022 | | 200 | | 175 | 0,01 |
| **Refinitiv U.S. Holdings, Inc.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2026 | € | 2.000 | | 2.051 | 0,08 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.05.2020 | $ | 500 | | 454 | 0,02 |
| **Rockwell Collins, Inc.** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.03.2022 | | 1.100 | | 976 | 0,04 |
| **Ryder System, Inc.** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 02.03.2020 | | 100 | | 88 | 0,00 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 500 | | 456 | 0,02 |
| **Shire Acquisitions Investments Irland DAC** | | | | | |
| 1,900 % fällig am 23.09.2019 | | 2.300 | | 2.017 | 0,08 |
| 2,400 % fällig am 23.09.2021 | | 700 | | 614 | 0,03 |
| **Solvay Finance America LLC** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 03.12.2020 | | 200 | | 177 | 0,01 |
| **Southern Co.** | | | | | |
| 2,350 % fällig am 01.07.2021 | | 3.626 | | 3.183 | 0,13 |
| **Stryker Corp.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2020 | € | 4.000 | | 4.005 | 0,16 |
| **Sunoco Logistics Partners Operations LP** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.02.2020 | $ | 100 | | 89 | 0,00 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.11.2021 | € | 900 | | 929 | 0,04 |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | $ | 600 | | 531 | 0,02 |
| 3,933 % fällig am 23.04.2021 | | 1.200 | | 1.073 | 0,04 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | | |
| 0,237 % fällig am 21.11.2020 | € | 9.300 | | 9.339 | 0,38 |
| 0,375 % fällig am 21.11.2020 | | 3.700 | | 3.727 | 0,15 |
| **TDF Infrastructure S.A.S.** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 07.04.2026 | | 800 | | 848 | 0,03 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | | | |
| 5,134 % fällig am 27.04.2020 | $ | 900 | | 807 | 0,03 |
| **Teleperformance** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.07.2025 | € | 300 | | 316 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Tesco PLC** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | £ | 75 | € | 94 | 0,00 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Co. BV** | | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | $ | 300 | | 255 | 0,01 |
| **Teva Pharmaceutical Finance LLC** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 18.03.2020 | | 600 | | 524 | 0,02 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Niederlande BV** | | | | | |
| 0,375 % fällig am 25.07.2020 | € | 500 | | 492 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2022 | | 4.000 | | 3.957 | 0,16 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.02.2022 | $ | 400 | | 360 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 01.03.2021 | | 300 | | 273 | 0,01 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.09.2021 | | 700 | | 631 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2020 | | 100 | | 89 | 0,00 |
| **United Technologies Corp.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.05.2020 | € | 6.750 | | 6.759 | 0,27 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | £ | 2.000 | | 2.307 | 0,09 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | | 2.100 | | 2.426 | 0,10 |
| **VMware, Inc.** | | | | | |
| 2,300 % fällig am 21.08.2020 | $ | 300 | | 263 | 0,01 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | | |
| 2,450 % fällig am 20.11.2019 | | 1.680 | | 1.475 | 0,06 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | | |
| 1,239 % fällig am 16.11.2024 | € | 2.600 | | 2.655 | 0,11 |
| 2,000 % fällig am 26.03.2021 | | 1.300 | | 1.346 | 0,05 |
| **Vulcan Grundstoffe Co.** | | | | | |
| 3,170 % fällig am 01.03.2021 | $ | 200 | | 176 | 0,01 |
| **WPP Finance** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 21.11.2021 | | 1.400 | | 1.289 | 0,05 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.04.2023 | € | 200 | | 211 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 29.04.2022 | $ | 400 | | 358 | 0,01 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | | |
| 1,414 % fällig am 13.12.2022 | € | 3.100 | | 3.215 | 0,13 |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | $ | 3.100 | | 2.766 | 0,11 |
| 3,169 % fällig am 19.03.2021 | | 300 | | 263 | 0,01 |
| 3,550 % fällig am 01.04.2025 | | 200 | | 181 | 0,01 |
| | | | | 148.584 | 5,96 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | | |
| **American Electric Power Co., Inc.** | | | | | |
| 2,150 % fällig am 13.11.2020 | | 300 | | 263 | 0,01 |
| **AT&T, Inc.** | | | | | |
| 0,528 % fällig am 05.09.2023 | € | 6.700 | | 6.788 | 0,27 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2022 | $ | 300 | | 274 | 0,01 |
| **BG Energie Capital PLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.10.2021 | | 400 | | 363 | 0,02 |
| **BP Capital Markets PLC** | | | | | |
| 2,518 % fällig am 16.01.2020 | | 1.100 | | 968 | 0,04 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 10.03.2021 | € | 4.000 | | 4.050 | 0,16 |
| 2,125 % fällig am 26.09.2028 | | 200 | | 216 | 0,01 |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** | | | | | |
| 2,701 % fällig am 16.03.2020 | $ | 400 | | 352 | 0,01 |
| **Duke Energie Corp.** | | | | | |
| 3,050 % fällig am 15.08.2022 | | 300 | | 269 | 0,01 |
| 5,050 % fällig am 15.09.2019 | | 100 | | 88 | 0,00 |
| **E.ON International Finance BV** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 30.10.2019 | £ | 500 | | 568 | 0,02 |
| **Electricite de Frankreich S.A.** | | | | | |
| 4,600 % fällig am 27.01.2020 | $ | 400 | | 356 | 0,01 |
| **Eurogrid GmbH** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 22.10.2020 | € | 4.000 | | 4.216 | 0,17 |
| **Eversource Energie** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.03.2022 | $ | 200 | | 178 | 0,01 |
| **Ohio Power Co.** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.10.2021 | | 500 | | 469 | 0,02 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | | |
| 5,999 % fällig am 27.01.2028 | | 224 | | 209 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 238 | | 224 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | | 600 | | 578 | 0,02 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2020 | | 100 | | 89 | 0,00 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.03.2020 | $ | 400 | € | 361 | 0,02 |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 600 | | 547 | 0,02 |
| **Telstra Corp. Ltd.** | | | | | |
| 4,800 % fällig am 12.10.2021 | | 800 | | 739 | 0,03 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 16.03.2027 | | 2.000 | | 1.912 | 0,08 |
| | | | | 24.077 | 0,96 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | | 894.550 | 35,86 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | | |
| 2,757 % fällig am 25.07.2037 | | 15 | | 13 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.06.2036 | | 93 | | 82 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.10.2029 - 01.08.2041 | | 2.074 | | 1.956 | 0,08 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.09.2049 | | 20.400 | | 18.040 | 0,72 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2034 - 01.09.2049 | | 216.100 | | 193.987 | 7,78 |
| **Freddie Mac** | | | | | |
| 1,854 % fällig am 15.01.2038 (a) | | 1.302 | | 75 | 0,00 |
| 2,859 % fällig am 15.01.2038 | | 1.302 | | 1.138 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2047 | | 9.220 | | 8.343 | 0,33 |
| 4,642 % fällig am 01.09.2037 | | 2.435 | | 2.255 | 0,09 |
| **Ginnie Mae** | | | | | |
| 2,917 % fällig am 20.08.2066 | | 429 | | 377 | 0,02 |
| | | | | 226.266 | 9,07 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | | 40.001 | | 35.983 | 1,44 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | | 73.796 | | 67.546 | 2,71 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | | 13.050 | | 12.852 | 0,52 |
| | | | | 116.381 | 4,67 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 3,863 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 29 | | 24 | 0,00 |
| **Aggregator of Loans Backed by Assets PLC** | | | | | |
| 1,972 % fällig am 24.04.2049 | £ | 2.157 | | 2.418 | 0,10 |
| **Alba PLC** | | | | | |
| 0,985 % fällig am 25.11.2042 | | 430 | | 457 | 0,02 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | | |
| 4,044 % fällig am 25.09.2045 | $ | 25 | | 23 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2047 | | 734 | | 625 | 0,03 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | | |
| 2,683 % fällig am 20.05.2047 | | 127 | | 107 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 4,118 % fällig am 25.07.2033 | | 11 | | 10 | 0,00 |
| 4,298 % fällig am 25.07.2036 | | 492 | | 322 | 0,01 |
| 4,730 % fällig am 25.10.2035 | | 81 | | 73 | 0,00 |
| 4,944 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 275 | | 236 | 0,01 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | | |
| 3,801 % fällig am 26.12.2046 ^ | | 120 | | 92 | 0,00 |
| **Bluestep Mortgage Securities DAC** | | | | | |
| 0,412 % fällig am 10.08.2066 | € | 1.594 | | 1.595 | 0,06 |
| 1,453 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 6.516 | | 620 | 0,02 |
| **Business Mortgage Finance PLC** | | | | | |
| 0,069 % fällig am 15.08.2040 | € | 559 | | 553 | 0,02 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | | |
| 4,357 % fällig am 25.01.2036 | $ | 5.043 | | 4.388 | 0,18 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 126 | | 85 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,990 % fällig am 25.11.2035 | | 82 | | 72 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | | |
| 4,433 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 737 | | 600 | 0,02 |
| 5,130 % fällig am 25.03.2034 | | 3 | | 3 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 4,243 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.331 | | 1.095 | 0,04 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.11.2036 | | 360 | | 307 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.07.2046 | | 210 | | 180 | 0,01 |
| 2,713 % fällig am 20.11.2035 | $ | 538 | € | 464 | 0,02 |
| 2,854 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 2.291 | | 1.575 | 0,06 |
| 3,504 % fällig am 25.12.2035 | | 7 | | 6 | 0,00 |
| 3,988 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 122 | | 102 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 7 | | 6 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 292 | | 199 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 425 | | 304 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 2,862 % fällig am 25.04.2035 | | 173 | | 139 | 0,01 |
| 2,984 % fällig am 25.04.2035 | | 218 | | 186 | 0,01 |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | | 295 | | 240 | 0,01 |
| 3,144 % fällig am 25.02.2035 | | 279 | | 234 | 0,01 |
| 3,675 % fällig am 20.05.2036 ^ | | 78 | | 66 | 0,00 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.08.2047 | | 5.114 | | 4.212 | 0,17 |
| **Dukinfield PLC** | | | | | |
| 1,806 % fällig am 15.08.2045 | £ | 1.855 | | 2.080 | 0,08 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | | |
| 0,318 % fällig am 28.04.2051 | € | 6.307 | | 6.312 | 0,25 |
| **Eurosail PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | | 2.480 | | 2.423 | 0,10 |
| 0,946 % fällig am 10.12.2044 | £ | 742 | | 819 | 0,03 |
| **F-E Mortgages SRL** | | | | | |
| 0,012 % fällig am 15.12.2043 | € | 31 | | 31 | 0,00 |
| **Feldspar PLC** | | | | | |
| 1,486 % fällig am 15.09.2045 | £ | 303 | | 338 | 0,01 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | | |
| 1,443 % fällig am 12.09.2065 | | 3.120 | | 3.484 | 0,14 |
| 1,910 % fällig am 16.06.2069 | | 5.800 | | 6.498 | 0,26 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 4,120 % fällig am 25.03.2035 | $ | 61 | | 44 | 0,00 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | | |
| 0,139 % fällig am 15.02.2058 | € | 7.150 | | 7.163 | 0,29 |
| 0,139 % fällig am 24.07.2058 | | 155 | | 155 | 0,01 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | | 645 | | 637 | 0,03 |
| 0,931 % fällig am 18.06.2038 | £ | 211 | | 232 | 0,01 |
| 2,532 % fällig am 18.06.2039 | $ | 147 | | 126 | 0,01 |
| **Grecale RMBS SRL** | | | | | |
| 0,188 % fällig am 27.01.2061 | € | 585 | | 585 | 0,02 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,396 % fällig am 25.01.2036 ^ | $ | 10 | | 9 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,618 % fällig am 19.05.2033 | | 9 | | 8 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | | |
| 2,195 % fällig am 25.05.2053 | £ | 2.067 | | 2.314 | 0,09 |
| **Hipocat FTA** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.01.2050 | € | 439 | | 433 | 0,02 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 | $ | 985 | | 823 | 0,03 |
| 3,910 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 132 | | 110 | 0,00 |
| **Juno Eclipse Ltd.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 20.11.2022 | € | 766 | | 751 | 0,03 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,436 % fällig am 15.12.2049 | £ | 1.935 | | 2.111 | 0,08 |
| **Mars SRL** | | | | | |
| 0,989 % fällig am 25.10.2050 | € | 774 | | 778 | 0,03 |
| **MASTR Asset Securitization Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | $ | 231 | | 197 | 0,01 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | | |
| 0,916 % fällig am 15.12.2050 | £ | 810 | | 900 | 0,04 |
| 1,786 % fällig am 15.12.2050 | | 380 | | 409 | 0,02 |
| **Oncilla Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 2,193 % fällig am 12.12.2043 | | 2.163 | | 2.436 | 0,10 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,760 % fällig am 15.05.2045 (b) | | 6.800 | | 7.605 | 0,31 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.03.2047 | $ | 2.157 | | 1.835 | 0,07 |
| 2,584 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 1.754 | | 974 | 0,04 |
| 2,584 % fällig am 25.06.2046 | | 391 | | 138 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 94 | | 77 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 656 | | 538 | 0,02 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | | 2.160 | | 1.893 | 0,08 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 1,936 % fällig am 15.06.2046 | £ | 421 | | 472 | 0,02 |
| 1,982 % fällig am 20.09.2065 | | 551 | | 619 | 0,02 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Resloc UK PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2043 | € | 1.234 | € 1.181 | 0,05 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | £ | 4.727 | 5.277 | 0,21 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 0,943 % fällig am 12.06.2044 | | 95 | 101 | 0,00 |
| 0,963 % fällig am 12.06.2044 | | 1.642 | 1.742 | 0,07 |
| **Rochester Financing PLC** | | | | |
| 2,081 % fällig am 18.06.2045 | | 1.936 | 2.175 | 0,09 |
| **SapphireOne Mortgages FCT** | | | | |
| 0,156 % fällig am 27.06.2061 | € | 7.627 | 7.670 | 0,31 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.01.2070 | | 2.868 | 2.870 | 0,12 |
| 0,139 % fällig am 21.01.2070 | | 4.300 | 4.307 | 0,17 |
| **Southern Pacific Financing PLC** | | | | |
| 0,966 % fällig am 10.06.2043 | £ | 135 | 150 | 0,01 |
| **Southern Pacific Securities PLC** | | | | |
| 1,086 % fällig am 10.03.2044 | | 2.608 | 2.894 | 0,12 |
| **Storm BV** | | | | |
| 0,289 % fällig am 22.01.2064 | € | 1.300 | 1.314 | 0,05 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.06.2036 | $ | 215 | 190 | 0,01 |
| 2,640 % fällig am 19.07.2035 | | 9 | 8 | 0,00 |
| 3,090 % fällig am 19.12.2034 | | 148 | 133 | 0,01 |
| 3,090 % fällig am 19.02.2035 | | 131 | 114 | 0,00 |
| 3,732 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 486 | 425 | 0,02 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 7.900 | 8.863 | 0,36 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 0,986 % fällig am 10.06.2059 | | 656 | 702 | 0,03 |
| 1,136 % fällig am 10.06.2059 | | 160 | 168 | 0,01 |
| 1,336 % fällig am 10.06.2059 | | 125 | 132 | 0,01 |
| 1,536 % fällig am 10.06.2059 | | 133 | 140 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 3,981 % fällig am 25.05.2037 ^ | $ | 1.654 | 1.421 | 0,06 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 1,775 % fällig am 21.09.2049 | £ | 2.747 | 3.079 | 0,12 |
| 2,275 % fällig am 21.09.2049 | | 1.402 | 1.578 | 0,06 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 3,254 % fällig am 25.02.2047 ^ | $ | 4.949 | 3.962 | 0,16 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | |
| 4,891 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 56 | 47 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 4,934 % fällig am 25.04.2036 | | 11 | 10 | 0,00 |
| 5,221 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 64 | 57 | 0,00 |
| | | | 128.685 | 5,16 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Accunia European CLO BV** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 7.300 | 7.314 | 0,29 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | $ | 615 | 261 | 0,01 |
| **Adagio CLO Ltd.** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2029 | € | 1.200 | 1.204 | 0,05 |
| **Allegro CLO Ltd.** | | | | |
| 3,803 % fällig am 30.01.2026 | $ | 2.429 | 2.134 | 0,09 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.01.2036 | | 2.000 | 1.752 | 0,07 |
| **Arbour CLO DAC** | | | | |
| 0,580 % fällig am 15.03.2029 | € | 1.100 | 1.097 | 0,04 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 7.000 | 6.999 | 0,28 |
| **Asset-Backed European Securitisation Transaction** | | | | |
| 0,004 % fällig am 23.08.2030 | | 3.067 | 3.079 | 0,12 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 3,404 % fällig am 25.06.2037 | $ | 110 | 84 | 0,00 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,680 % fällig am 13.10.2029 | € | 5.800 | 5.785 | 0,23 |
| **Auto ABS French Leases** | | | | |
| 0,192 % fällig am 28.05.2030 | | 8.000 | 8.036 | 0,32 |
| **Babson Euro CLO BV** | | | | |
| 0,509 % fällig am 25.10.2029 | | 6.100 | 6.076 | 0,24 |
| **Barings Euro CLO BV** | | | | |
| 0,680 % fällig am 27.07.2030 | | 3.400 | 3.392 | 0,14 |
| 1,050 % fällig am 27.07.2030 | | 300 | 300 | 0,01 |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | |
| 0,012 % fällig am 20.05.2024 | € | 648 | € 649 | 0,03 |
| 0,012 % fällig am 20.06.2025 | | 3.303 | 3.312 | 0,13 |
| **Black Diamond CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | | 5.200 | 5.206 | 0,21 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 15.04.2027 | | 2.337 | 2.336 | 0,09 |
| **Bumper NL Finance BV** | | | | |
| 0,004 % fällig am 22.07.2031 | | 5.610 | 5.620 | 0,23 |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | |
| 1,254 % fällig am 20.11.2027 | £ | 482 | 539 | 0,02 |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | € | 600 | 602 | 0,02 |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | | 7.100 | 7.108 | 0,29 |
| 0,930 % fällig am 30.04.2031 | | 200 | 201 | 0,01 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 21.09.2029 | | 900 | 900 | 0,04 |
| 0,870 % fällig am 18.01.2030 | | 7.000 | 7.001 | 0,28 |
| 1,200 % fällig am 21.09.2029 | | 400 | 405 | 0,02 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,780 % fällig am 16.04.2029 | | 1.400 | 1.409 | 0,06 |
| **Cars Alliance Auto Loans Frankreich** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.10.2029 | | 16.200 | 16.245 | 0,65 |
| **Castle Park CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.01.2028 | | 2.900 | 2.907 | 0,12 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.06.2035 | $ | 6.982 | 5.617 | 0,23 |
| 2,624 % fällig am 25.06.2047 | | 5.000 | 4.262 | 0,17 |
| 2,664 % fällig am 25.11.2037 | | 2.100 | 1.756 | 0,07 |
| 4,763 % fällig am 25.07.2036 | | 497 | 447 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 3,244 % fällig am 25.10.2047 | | 2.667 | 2.344 | 0,09 |
| **CVC Cordatus Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 0,970 % fällig am 22.04.2030 | € | 15.900 | 15.968 | 0,64 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | | 1.500 | 1.502 | 0,06 |
| **Driver Espana** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.12.2028 | | 659 | 662 | 0,03 |
| **Driver Multi-Compartment S.A.** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.02.2026 | | 1.469 | 1.472 | 0,06 |
| 0,009 % fällig am 21.08.2026 | | 8.360 | 8.391 | 0,34 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | | |
| 0,718 % fällig am 17.05.2027 | | 2.694 | 2.696 | 0,11 |
| 0,880 % fällig am 15.01.2030 | | 7.000 | 7.007 | 0,28 |
| **Duchess CLO BV** | | | | |
| 1,033 % fällig am 28.02.2023 | | 2.577 | 2.587 | 0,10 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.05.2037 | $ | 5.295 | 4.665 | 0,19 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | € | 8.000 | 8.001 | 0,32 |
| **FACT Master S.A.** | | | | |
| 0,109 % fällig am 20.11.2025 | | 7.845 | 7.873 | 0,32 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.11.2036 | $ | 591 | 509 | 0,02 |
| **Flatiron CLO Ltd.** | | | | |
| 3,748 % fällig am 17.01.2026 | | 357 | 314 | 0,01 |
| **Globaldrive Auto Receivables BV** | | | | |
| 0,009 % fällig am 20.08.2025 | € | 652 | 654 | 0,03 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | | 3.600 | 3.602 | 0,14 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,609 % fällig am 15.11.2028 | | 2.788 | 2.787 | 0,11 |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 3.150 | 3.150 | 0,13 |
| **Holland Park CLO Ltd.** | | | | |
| 0,621 % fällig am 14.05.2027 | | 2.568 | 2.569 | 0,10 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 2,539 % fällig am 25.07.2036 | $ | 126 | 89 | 0,00 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | € | 7.900 | 7.881 | 0,32 |
| 0,530 % fällig am 12.07.2028 | | 5.000 | 5.000 | 0,20 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.06.2046 | $ | 3.773 | 3.318 | 0,13 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.05.2036 | | 2.928 | 1.719 | 0,07 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | | 6.266 | 3.088 | 0,12 |
| **Man GLG Euro CLO DAC** | | | | |
| 1,030 % fällig am 15.01.2030 | € | 1.900 | € 1.901 | 0,08 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.10.2036 | $ | 3.639 | 1.436 | 0,06 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 3,379 % fällig am 25.04.2036 | | 2.650 | 2.317 | 0,09 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,529 % fällig am 25.07.2036 | | 564 | 434 | 0,02 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.12.2036 | | 3.629 | 1.870 | 0,08 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 864 | 734 | 0,03 |
| 2,814 % fällig am 25.02.2036 | | 62 | 55 | 0,00 |
| **North Westerly CLO BV** | | | | |
| 0,644 % fällig am 15.01.2026 | € | 1.360 | 1.360 | 0,05 |
| 1,250 % fällig am 15.01.2026 | | 291 | 292 | 0,01 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.09.2037 | $ | 1.117 | 958 | 0,04 |
| 3,109 % fällig am 25.01.2036 | | 400 | 351 | 0,01 |
| **Penta CLO BV** | | | | |
| 0,790 % fällig am 04.08.2028 | € | 1.800 | 1.802 | 0,07 |
| **Purple Master Credit Cards** | | | | |
| 0,052 % fällig am 25.10.2030 | | 6.500 | 6.526 | 0,26 |
| **Red & Black Auto Deutschland UG** | | | | |
| 0,124 % fällig am 15.09.2025 | | 1.364 | 1.367 | 0,06 |
| **Red & Black Auto Lease Deutschland S.A.** | | | | |
| 0,024 % fällig am 15.11.2027 | | 2.530 | 2.531 | 0,10 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,404 % fällig am 25.12.2033 | $ | 36 | 31 | 0,00 |
| **SC Deutschland Auto UG** | | | | |
| 0,023 % fällig am 13.12.2026 | € | 4.064 | 4.074 | 0,16 |
| **SCF Rahoituspalvelut Kimi DAC** | | | | |
| 0,002 % fällig am 25.11.2026 | | 1.234 | 1.237 | 0,05 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | | |
| 0,074 % fällig am 17.03.2025 | | 1.771 | 1.775 | 0,07 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | |
| 3,396 % fällig am 25.11.2042 | $ | 1.895 | 1.671 | 0,07 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,089 % fällig am 25.10.2039 | € | 718 | 697 | 0,03 |
| **Sorrento Park CLO DAC** | | | | |
| 0,639 % fällig am 16.11.2027 | | 3.192 | 3.195 | 0,13 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.10.2036 | $ | 6.200 | 5.255 | 0,21 |
| **St Paul's CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 20.08.2030 | € | 11.000 | 11.010 | 0,44 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,880 % fällig am 07.12.2029 (b) | | 8.900 | 8.900 | 0,36 |
| 1,060 % fällig am 07.12.2029 | | 1.100 | 1.101 | 0,04 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 15.10.2030 | | 8.600 | 8.621 | 0,35 |
| **VCL Multi-Compartment S.A.** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.09.2023 | | 3.316 | 3.321 | 0,13 |
| 0,009 % fällig am 21.08.2024 | | 12.008 | 12.043 | 0,48 |
| 0,009 % fällig am 21.01.2025 | | 3.523 | 3.535 | 0,14 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 3,742 % fällig am 22.10.2031 | $ | 5.700 | 5.004 | 0,20 |
| | | | 307.287 | 12,32 |

## STAATSEMISSIONEN

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.11.2023 | € | 2.000 | 2.037 | 0,08 |
| **Auckland Council** | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.01.2027 | | 1.300 | 1.383 | 0,06 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035 | | 1.600 | 1.926 | 0,08 |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | | 1.000 | 1.082 | 0,04 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 15.920 | 16.375 | 0,66 |
| **Autonomous Community of Valencia** | | | | |
| 4,900 % fällig am 17.03.2020 | | 600 | 621 | 0,03 |
| **Belgium Government International Bond** | | | | |
| 1,600 % fällig am 22.06.2047 | | 7.600 | 8.841 | 0,35 |
| 2,150 % fällig am 22.06.2066 | | 5.500 | 7.209 | 0,29 |
| **BpiFrankreich Financement S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.11.2022 (c) | | 2.000 | 2.025 | 0,08 |
| 0,125 % fällig am 25.11.2023 | | 5.000 | 5.093 | 0,20 |
| 1,000 % fällig am 25.10.2019 | | 10.900 | 10.950 | 0,44 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Deposit Insurance Corp. of Japan** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 17.01.2020 | ¥ | 1.300.000 | € | 10.604 | 0,43 |
| **Export-Import Bank of China** | | | | | |
| 0,300 % fällig am 06.03.2022 | € | 4.000 | | 4.040 | 0,16 |
| **Frankreich Government International Bond** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 25.05.2050 | | 34.700 | | 39.950 | 1,60 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.03.2067 | | 4.600 | | 4.322 | 0,17 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 13.04.2021 | $ | 5.200 | | 4.564 | 0,18 |
| **Lithuania Government International Bond** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 09.03.2021 | | 7.300 | | 6.814 | 0,27 |
| **Mexiko Government International Bond** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.04.2023 | € | 100 | | 109 | 0,00 |
| **Nederlandse Financierings-Maatschappij voor Ontwikkelingslanden NV** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 04.11.2020 | | 2.300 | | 2.322 | 0,09 |
| **Polen Government International Bond** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.10.2023 | PLN | 200 | | 51 | 0,00 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 06.03.2028 | € | 12.200 | | 13.233 | 0,53 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 21.451 | | 21.205 | 0,85 |
| **Spanien Government International Bond** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 30.07.2021 | € | 2.600 | | 2.664 | 0,11 |
| 1,300 % fällig am 31.10.2026 | | 6.400 | | 6.946 | 0,28 |
| 1,400 % fällig am 30.04.2028 | | 10.600 | | 11.645 | 0,47 |
| 1,400 % fällig am 30.07.2028 | | 58.900 | | 64.612 | 2,59 |
| 1,450 % fällig am 31.10.2027 | | 52.800 | | 58.113 | 2,33 |
| 1,450 % fällig am 30.04.2029 | € | 23.300 | € | 25.678 | 1,03 |
| 1,500 % fällig am 30.04.2027 | | 17.800 | | 19.618 | 0,79 |
| 1,950 % fällig am 30.04.2026 | | 28.300 | | 31.928 | 1,28 |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 18.400 | | 20.896 | 0,84 |
| 3,450 % fällig am 30.07.2066 | | 7.000 | | 10.952 | 0,44 |
| 3,800 % fällig am 30.04.2024 | | 250 | | 298 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 30.04.2020 | | 40.200 | | 41.675 | 1,67 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.05.2021 | $ | 2.600 | | 2.276 | 0,09 |
| | | | | 462.057 | 18,52 |

**AKTIEN**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (g) | 2.413.090 | 241.840 | 9,70 |

**PARI (000S)**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| **Natwest Markets PLC** | | | | |
| (0,243) % fällig am 31.03.2020 | € | 8.200 | 8.219 | 0,33 |
| (0,193) % fällig am 27.09.2019 | | 4.800 | 4.805 | 0,19 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 0,193 % fällig am 16.07.2019 | | 12.000 | 12.003 | 0,48 |
| | | | 25.027 | 1,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **PENSIONSGESCHÄFTE (i)** | | € 76.294 | 3,06 |
| **ITALY TREASURY BILLS** | | | |
| 0,679 % fällig am 13.09.2019 (c)(d) | € 53.500 | 53.524 | 2,14 |
| 0,700 % fällig am 13.09.2019 (c)(d) | 53.500 | 53.524 | 2,14 |
| 0,707 % fällig am 13.09.2019 (c)(d) | 17.100 | 17.108 | 0,69 |
| 0,710 % fällig am 13.09.2019 (c)(d) | 5.300 | 5.302 | 0,21 |
| 0,711 % fällig am 13.09.2019 (c)(d) | 7.400 | 7.403 | 0,30 |
| 0,720 % fällig am 13.09.2019 (c)(d) | 8.900 | 8.904 | 0,36 |
| | | 145.765 | 5,84 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | |
| (0,170) % fällig am 13.08.2019 (c)(d) | ¥ 2.600.000 | 21.194 | 0,85 |
| (0,140) % fällig am 09.09.2019 (c)(d) | 3.440.000 | 28.044 | 1,13 |
| | | 49.238 | 1,98 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 296.324 | 11,88 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | € 2.678.585 | 107,39 |

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 134,500 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 400 | € (9) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 192 | (421) | (0,02) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 162 | (288) | (0,01) |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09/2019 | 2.552 | 1.411 | 0,05 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09/2019 | 1.209 | 5.838 | 0,23 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 2.384 | 4.733 | 0,19 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 854 | 4.364 | 0,18 |
| Euro-OAT Frankreich Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 186 | 458 | 0,02 |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09/2019 | 1.483 | (250) | (0,01) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 112,100 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 1.230 | 53 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 156,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 201 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 192 | 189 | 0,01 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 162 | 141 | 0,01 |
| Swedish Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 1 | (151) | (0,01) |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 465 | 68 | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 1.063 | (1.004) | (0,04) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 508 | (900) | (0,04) |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 98 | 112 | 0,01 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | Long | 09/2019 | 328 | 555 | 0,02 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 188 | 227 | 0,01 |
| | | | | € 15.126 | 0,60 |

[1] Future-Style-Option.

## OPTIONSKAUF

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | $ 108,000 | 23.08.2019 | 90 | € 1 | € 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 109,500 | 23.08.2019 | 18 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 122,000 | 23.08.2019 | 144 | 1 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 144,000 | 23.08.2019 | 131 | 1 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 144,500 | 23.08.2019 | 328 | 3 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 145,000 | 23.08.2019 | 3 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 146,000 | 23.08.2019 | 21 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 146,500 | 23.08.2019 | 12 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 148,500 | 23.08.2019 | 80 | 1 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 149,500 | 23.08.2019 | 539 | 4 | 1 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 102,750 | 23.08.2019 | 93 | 1 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 103,000 | 23.08.2019 | 37 | 0 | 0 | 0,00 |

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | $ 103,625 | 23.08.2019 | 231 | € 2 | € 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 103,750 | 23.08.2019 | 136 | 1 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 121,000 | 23.08.2019 | 84 | 1 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 104,000 | 23.08.2019 | 8 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 106,250 | 23.08.2019 | 313 | 2 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 106,750 | 23.08.2019 | 46 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 127,750 | 23.08.2019 | 51 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,000 | 23.08.2019 | 79 | 1 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,750 | 23.08.2019 | 415 | 3 | 1 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 129,500 | 23.08.2019 | 59 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 130,000 | 23.08.2019 | 214 | 2 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 130,250 | 23.08.2019 | 393 | 3 | 1 | 0,00 |
| | | | | € 27 | € 3 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **€ 15.129** | **0,60** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 % | 20.12.2022 | $ 2.300 | € (95) | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 20.06.2048 | $ 8.900 | € (1.161) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 67.100 | 278 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,000 | 19.12.2023 | ZAR 500.400 | 1.293 | 0,05 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2024 | € 183.500 | 769 | 0,03 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | 3.700 | 74 | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,750 | 15.03.2028 | 72.350 | 5.085 | 0,21 |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 | 15.03.2028 | £ 17.300 | (731) | (0,03) |
| | | | | | € 5.607 | 0,22 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ 5.512** | **0,22** |

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

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

(3) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 % | 18.09.2019 | 63.300 | € (111) | € (16) | 0,00 |
| GST | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 29.600 | (50) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | € (161) | € (16) | 0,00 |

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,776 % | 05.12.2019 | 27.950 | € (677) | € (3.067) | (0,13) |
| FBF | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,770 | 05.12.2019 | 28.200 | (639) | (3.067) | (0,12) |
| MYC | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,642 | 18.12.2019 | 28.000 | (561) | (2.438) | (0,10) |
| | | | | | | | € (1.877) | € (8.572) | (0,35) |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 200 | € (8) | € 4 | € (4) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 21.500 | (838) | 256 | (582) | (0,02) |
| | | | | | € (846) | € 260 | € (586) | (0,02) |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 1.328 | COP | 4.492.319 | € 64 | € 0 | € 64 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 3.331 | RUB | 218.806 | 102 | 0 | 102 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € | 12.676 | DKK | 94.635 | 5 | (1) | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 15.327 | $ | 17.340 | 0 | (100) | (100) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 27.568 | € | 24.287 | 79 | 0 | 79 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 1.098 | £ | 981 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | | 12.994 | ¥ | 1.588.400 | 0 | (51) | (51) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 2.289 | € | 2.627 | 73 | 0 | 73 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 56 | MXN | 1.115 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 7.595.208 | $ | 6.453 | 0 | (107) | (107) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 5.422 | COP | 18.317.127 | 227 | 0 | 227 | 0,01 |
| | 10/2019 | MXN | 1.115 | $ | 55 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 04/2020 | DKK | 79.385 | € | 10.653 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | | 76.035 | | 10.189 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | € | 406.712 | $ | 462.228 | 0 | (821) | (821) | (0,03) |
| | 07/2019 | PLN | 427 | | 113 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 561 | ZAR | 8.217 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 462.655 | € | 406.052 | 822 | 0 | 822 | 0,03 |
| GLM | 07/2019 | € | 7.483 | $ | 8.447 | 0 | (66) | (66) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 8.667 | RUB | 575.221 | 382 | 0 | 382 | 0,01 |
| | 08/2019 | € | 10.736 | £ | 9.582 | 2 | (45) | (43) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 2.190 | € | 204 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 6.112 | IDR | 89.689.740 | 153 | 0 | 153 | 0,01 |
| | 10/2019 | | 57 | MXN | 1.115 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | € | 27 | DKK | 202 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 8.116 | $ | 5.939 | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 62.375 | € | 8.373 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 10/2019 | € | 13.968 | DKK | 104.220 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 104.955 | $ | 3.353 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 01/2020 | DKK | 86.905 | € | 11.657 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2020 | | 202 | | 27 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 66.605 | | 8.927 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 4.627 | DKK | 34.530 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 158 | € | 97 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 2.601.100 | | 21.193 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 4.225 | | 391 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 33.723 | $ | 1.075 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 01/2020 | DKK | 65.920 | € | 8.845 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 94.605 | | 12.682 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 5.929 | ZAR | 86.917 | 202 | 0 | 202 | 0,01 |
| | 01/2020 | DKK | 7.604 | € | 1.020 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2020 | | 363.266 | | 48.762 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| RBC | 07/2019 | COP | 4.492.319 | $ | 1.413 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 1.407 | COP | 4.492.319 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 01/2020 | € | 8.845 | DKK | 65.920 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | DKK | 105.991 | € | 14.206 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.750 | | 1.551 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 1.401 | £ | 1.251 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 09/2019 | ¥ | 3.440.000 | € | 28.306 | 280 | 0 | 280 | 0,01 |
| | 10/2019 | DKK | 26.560 | | 3.562 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2020 | | 65.000 | | 8.722 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 97.366 | | 13.048 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | CHF | 6.707 | | 5.929 | 0 | (115) | (115) | (0,01) |
| | 08/2019 | £ | 80.302 | | 92.747 | 3.135 | 0 | 3.135 | 0,12 |
| | 08/2019 | ¥ | 1.379.000 | | 11.227 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 42.077 | $ | 1.344 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 01/2020 | DKK | 75.800 | € | 10.177 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € | 2.373 | DKK | 17.715 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ | 457.980 | € | 409.566 | 7.406 | 0 | 7.406 | 0,30 |
| UAG | 07/2019 | € | 38.600 | DKK | 288.166 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 330 | € | 291 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 288.166 | | 38.621 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | | | | | | € 13.043 | € (1.512) | € 11.531 | 0,46 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | CHF 113.929 | € 102.472 | € 0 | € (137) | € (137) | (0,01) |
| | 07/2019 | € 88.805 | CHF 99.513 | 820 | 0 | 820 | 0,03 |
| | 08/2019 | 102.508 | 113.929 | 138 | 0 | 138 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | 106.967 | 120.000 | 1.109 | 0 | 1.109 | 0,05 |
| SCX | 07/2019 | CHF 114.268 | € 102.905 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | € 2.785 | CHF 3.109 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08/2019 | 102.941 | 114.268 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | 99.629 | 111.987 | 1.231 | 0 | 1.231 | 0,05 |
| | | | | € 3.324 | € (145) | € 3.179 | 0,13 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **€ 5.536** | **0,22** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **€ 2.704.762** | **108,43** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **€ (210.396)** | **(8,43)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **€ 2.494.366** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(c) Nullkuponwertpapier.**

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

**(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

**(g) Mit dem Fonds verbunden.**

**(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**Barmittel in Höhe von EUR 20.529 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von EUR 9.200 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(i) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 7.168 | U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2021 | € (6.422) | € 6.294 | € 6.296 | 0,25 |
| RYL | (0,500) | 28.06.2019 | 01.07.2019 | € 70.000 | Republic of Germany 6,500 % fällig am 04.07.2027 | (70.315) | 70.000 | 69.997 | 2,81 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (76.737)** | **€ 76.294** | **€ 76.293** | **3,06** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 241.840 | € 2.436.745 | € 0 | € 2.678.585 |
| Finanzderivate[3] | 15.129 | 11.048 | 0 | 26.177 |
| **Summen** | **€ 256.969** | **€ 2.447.793** | **€ 0** | **€ 2.704.762** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 188.100 | € 1.895.768 | € 0 | € 2.083.868 |
| Finanzderivate[3] | 5.098 | 1.124 | 0 | 6.222 |
| **Summen** | **€ 193.198** | **€ 1.896.892** | **€ 0** | **€ 2.090.090** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € 987 | € (890) | € 97 |
| BPS | (2.947) | 2.860 | (87) |
| BRC | (14) | 0 | (14) |
| CBK | 19 | (250) | (231) |
| DUB | 0 | (10) | (10) |
| FBF | (3.067) | 3.020 | (47) |
| GLM | 1.532 | (1.500) | 32 |
| GST | (586) | 630 | 44 |
| HUS | (94) | 0 | (94) |
| JPM | (24) | 290 | 266 |
| MYC | (2.438) | 1.730 | (708) |
| MYI | 213 | (10) | 203 |
| RBC | (3) | 0 | (3) |
| RYL | 298 | (420) | (122) |
| SCX | 3.022 | (3.020) | 2 |
| SSB | 1 | 0 | 1 |
| TOR | 7.406 | (6.990) | 416 |
| UAG | 1.231 | (1.380) | (149) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 97,26 | 86,43 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 6,72 | 17,26 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 3,41 | 1,64 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,60 | 0,25 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,22 | (0,13) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,22 | 0,19 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 0,21 | 0,26 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 35,86 | 36,24 |
| US-Regierungsbehörden | 9,07 | 7,69 |
| US-Schatzobligationen | 4,67 | 3,69 |
| Non-Agency-MBS | 5,16 | 4,95 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 12,32 | 13,14 |
| Staatsemissionen | 18,52 | 18,38 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 9,70 | 9,51 |
| Kurzfristige Instrumente | 11,88 | 11,47 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,60 | 0,25 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,00 | (0,03) |
| Zinsswaps | 0,22 | (0,08) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoption | 0,00 | 0,25 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Zinsswapoption | (0,35) | (0,14) |
| Zinscaps | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,02) | (0,05) |
| Devisenterminkontrakte | 0,46 | 0,09 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,13 | 0,05 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (8,43) | (5,64) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **Altice France S.A.** | | | | | |
| 6,394 % fällig am 14.08.2026 | $ | 499 | € | 430 | 0,04 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 4,330 % fällig am 30.04.2025 | | 3.419 | | 3.002 | 0,31 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 4,410 % fällig am 07.09.2023 | | 1.173 | | 1.025 | 0,11 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | | |
| 4,154 % fällig am 25.10.2023 | | 3.240 | | 2.850 | 0,29 |
| **Ineos Finance LLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 31.03.2024 | € | 3.448 | | 3.437 | 0,36 |
| **Numericable Group S.A.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2026 | | 3.448 | | 3.342 | 0,35 |
| | | | | 14.086 | 1,46 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | | |
| **Aegon Bank NV** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2024 | | 500 | | 504 | 0,05 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | | |
| 4,450 % fällig am 16.12.2021 | $ | 600 | | 547 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | | 550 | | 498 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2021 | | 200 | | 184 | 0,02 |
| **AIB Group PLC** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 29.03.2023 | € | 1.500 | | 1.543 | 0,16 |
| **Akelius Residential Property AB** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 23.09.2020 | | 2.500 | | 2.606 | 0,27 |
| **American Tower Corp.** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 04.04.2025 | | 1.300 | | 1.351 | 0,14 |
| 1,950 % fällig am 22.05.2026 | | 500 | | 535 | 0,06 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.07.2024 | | 6.400 | | 6.679 | 0,69 |
| 2,125 % fällig am 13.03.2023 | | 3.000 | | 3.195 | 0,33 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | | 1.900 | | 2.037 | 0,21 |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 19.04.2021 | $ | 5.200 | | 4.596 | 0,48 |
| 4,100 % fällig am 24.07.2023 | | 1.100 | | 1.032 | 0,11 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 29.08.2023 | € | 2.600 | | 2.659 | 0,28 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 26.04.2021 | $ | 1.800 | | 1.576 | 0,16 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 1.400 | | 1.799 | 0,19 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | | 3.000 | | 3.357 | 0,35 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | | 6.600 | | 7.597 | 0,79 |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | $ | 3.600 | | 3.273 | 0,34 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.02.2023 | € | 2.600 | | 2.698 | 0,28 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | | |
| 1,400 % fällig am 06.07.2022 | | 1.600 | | 1.639 | 0,17 |
| 2,000 % fällig am 15.02.2024 | | 2.500 | | 2.624 | 0,27 |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | | 300 | | 317 | 0,03 |
| **BNP Paribas Cardif S.A.** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 29.11.2024 | | 1.000 | | 1.007 | 0,10 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.11.2023 | | 1.600 | | 1.655 | 0,17 |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | $ | 1.000 | | 952 | 0,10 |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 16.300 | | 15.366 | 1,59 |
| **BPCE S.A.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 22.05.2022 | | 10.750 | | 9.533 | 0,99 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 27.03.2026 | € | 400 | | 411 | 0,04 |
| 1,375 % fällig am 19.06.2026 | | 1.900 | | 1.925 | 0,20 |
| **Castellum AB** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | | 2.600 | | 2.755 | 0,29 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 19.01.2021 | $ | 4.750 | | 4.187 | 0,43 |
| 3,875 % fällig am 08.02.2022 | | 750 | | 686 | 0,07 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | € | 900 | | 914 | 0,09 |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | € | 1.500 | € | 1.539 | 0,16 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 800 | | 728 | 0,08 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 05.03.2029 | € | 1.000 | | 1.076 | 0,11 |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.09.2021 | | 400 | | 410 | 0,04 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2021 | | 1.300 | | 1.343 | 0,14 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.07.2025 | | 10.200 | | 10.587 | 1,10 |
| 2,997 % fällig am 14.12.2023 | $ | 9.400 | | 8.329 | 0,86 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 2.100 | | 2.118 | 0,22 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2020 | £ | 800 | | 894 | 0,09 |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | € | 800 | | 812 | 0,08 |
| 3,150 % fällig am 22.01.2021 | $ | 827 | | 721 | 0,07 |
| 3,375 % fällig am 12.05.2021 | | 6.300 | | 5.510 | 0,57 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 6.100 | | 5.432 | 0,56 |
| 5,000 % fällig am 14.02.2022 | | 1.700 | | 1.539 | 0,16 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 15.09.2021 | | 300 | | 263 | 0,03 |
| 2,375 % fällig am 20.09.2022 | | 3.000 | | 2.662 | 0,28 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2024 | € | 2.600 | | 2.856 | 0,30 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | $ | 569 | | 520 | 0,05 |
| **Dream Global Funding SARL** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 21.12.2021 | € | 200 | | 204 | 0,02 |
| 1,750 % fällig am 28.06.2026 | | 1.200 | | 1.214 | 0,13 |
| **Equinix, Inc.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.03.2024 | | 1.900 | | 1.991 | 0,21 |
| **Erste Group Bank AG** | | | | | |
| 0,375 % fällig am 16.04.2024 | | 1.000 | | 1.013 | 0,11 |
| **Euroclear Bank S.A.** | | | | | |
| 0,040 % fällig am 10.07.2020 | | 1.000 | | 1.003 | 0,10 |
| 0,077 % fällig am 08.03.2021 | | 4.800 | | 4.819 | 0,50 |
| 0,500 % fällig am 10.07.2023 | | 600 | | 613 | 0,06 |
| **Euronext NV** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 12.06.2029 | | 200 | | 205 | 0,02 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | | 1.000 | | 1.073 | 0,11 |
| **FCE Bank PLC** | | | | | |
| 0,869 % fällig am 13.09.2021 | | 2.100 | | 2.107 | 0,22 |
| 1,875 % fällig am 24.06.2021 | | 1.400 | | 1.433 | 0,15 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | | 300 | | 294 | 0,03 |
| 0,100 % fällig am 07.12.2022 | | 1.000 | | 961 | 0,10 |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | | 1.600 | | 1.583 | 0,16 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | | 300 | | 318 | 0,03 |
| 3,157 % fällig am 04.08.2020 | $ | 2.600 | | 2.292 | 0,24 |
| 3,408 % fällig am 05.04.2021 | | 200 | | 173 | 0,02 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 800 | | 755 | 0,08 |
| 5,596 % fällig am 07.01.2022 | | 500 | | 465 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2021 | | 1.800 | | 1.646 | 0,17 |
| **GE Capital European Funding Unlimited Co.** | | | | | |
| 0,069 % fällig am 21.01.2020 | € | 7.500 | | 7.504 | 0,78 |
| 0,800 % fällig am 21.01.2022 | | 200 | | 204 | 0,02 |
| **GELF Bond Issuer S.A.** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 20.10.2022 | | 1.400 | | 1.427 | 0,15 |
| 1,750 % fällig am 22.11.2021 | | 1.200 | | 1.248 | 0,13 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | | |
| 0,207 % fällig am 26.03.2022 | | 500 | | 494 | 0,05 |
| 2,200 % fällig am 01.04.2024 | | 600 | | 632 | 0,07 |
| 4,147 % fällig am 14.01.2022 | $ | 100 | | 89 | 0,01 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 20.06.2022 | € | 3.300 | | 3.504 | 0,36 |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | | 400 | | 426 | 0,04 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 0,132 % fällig am 16.12.2020 | | 200 | | 200 | 0,02 |
| 0,277 % fällig am 26.09.2023 | | 2.000 | | 1.994 | 0,21 |
| 1,375 % fällig am 15.05.2024 | | 11.700 | | 12.131 | 1,26 |
| 2,000 % fällig am 27.07.2023 | | 5.600 | | 5.983 | 0,62 |
| 2,125 % fällig am 30.09.2024 | | 3.200 | | 3.478 | 0,36 |
| **Groupe Bruxelles Lambert S.A.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 19.06.2025 | | 400 | | 418 | 0,04 |
| **Hamburg Commercial Bank AG** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 19.11.2020 | | 300 | | 303 | 0,03 |
| **HSBC France S.A.** | | | | | |
| 0,600 % fällig am 20.03.2023 | | 1.300 | | 1.330 | 0,14 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 0,190 % fällig am 05.10.2023 | € | 1.700 | € | 1.693 | 0,18 |
| 3,400 % fällig am 08.03.2021 | $ | 6.200 | | 5.530 | 0,57 |
| 4,875 % fällig am 14.01.2022 | | 3.800 | | 3.536 | 0,37 |
| **Inmobiliaria Colonial Socimi S.A.** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.04.2026 | € | 2.100 | | 2.249 | 0,23 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.01.2023 | $ | 3.100 | | 2.714 | 0,28 |
| **JAB Holdings BV** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.04.2025 | € | 4.200 | | 4.451 | 0,46 |
| 1,750 % fällig am 25.05.2023 | | 1.700 | | 1.801 | 0,19 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 23.09.2022 | $ | 1.700 | | 1.534 | 0,16 |
| 4,500 % fällig am 24.01.2022 | | 6.222 | | 5.759 | 0,60 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 1.118 | | 155 | 0,02 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 17.000 | | 2.313 | 0,24 |
| **Kojamo Oyj** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 19.06.2024 | € | 3.400 | | 3.516 | 0,36 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 03.10.2022 | | 3.500 | | 3.545 | 0,37 |
| 1,000 % fällig am 02.05.2023 | | 2.400 | | 2.444 | 0,25 |
| **Liberty Mutual Group, Inc.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 04.05.2026 | | 700 | | 775 | 0,08 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | | |
| 0,375 % fällig am 18.01.2021 | | 600 | | 607 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 29.09.2020 | | 900 | | 949 | 0,10 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | £ | 5.100 | | 5.727 | 0,59 |
| 4,050 % fällig am 16.08.2023 | $ | 4.600 | | 4.219 | 0,44 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | € | 2.800 | | 2.898 | 0,30 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | | 5.000 | | 5.337 | 0,55 |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | | 2.500 | | 2.774 | 0,29 |
| **London Stock Exchange Group PLC** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 19.09.2024 | | 100 | | 103 | 0,01 |
| 1,750 % fällig am 19.09.2029 | | 200 | | 213 | 0,02 |
| **Merlin Properties Socimi S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 26.05.2025 | | 2.800 | | 2.935 | 0,30 |
| 2,225 % fällig am 25.04.2023 | | 1.200 | | 1.280 | 0,13 |
| **Metropolitan Life Global Funding** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.09.2021 | | 5.700 | | 5.884 | 0,61 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 0,980 % fällig am 09.10.2023 | | 1.100 | | 1.134 | 0,12 |
| 2,190 % fällig am 13.09.2021 | $ | 1.600 | | 1.398 | 0,15 |
| **Morgan Stanley** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 02.12.2022 | € | 6.000 | | 6.187 | 0,64 |
| 1,342 % fällig am 23.10.2026 | | 6.300 | | 6.570 | 0,68 |
| 1,875 % fällig am 30.03.2023 | | 1.900 | | 2.021 | 0,21 |
| 2,625 % fällig am 17.11.2021 | $ | 3.900 | | 3.447 | 0,36 |
| 3,522 % fällig am 22.07.2022 | | 200 | | 177 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 29.04.2024 | | 1.400 | | 1.304 | 0,14 |
| **Nasdaq, Inc.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 28.03.2029 | € | 2.000 | | 2.128 | 0,22 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | | |
| 0,350 % fällig am 07.09.2022 | | 6.700 | | 6.791 | 0,70 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 08.03.2026 | | 1.300 | | 1.330 | 0,14 |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | $ | 4.000 | | 3.669 | 0,38 |
| 6,750 % fällig am 22.07.2020 | € | 300 | | 321 | 0,03 |
| **NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 10.03.2020 | | 600 | | 602 | 0,06 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 470 | | 65 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 49.500 | | 6.735 | 0,70 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 100 | | 14 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 939 | | 131 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 114.600 | | 15.592 | 1,62 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 181 | | 26 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 21 | | 3 | 0,00 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | | |
| 1,876 % fällig am 17.04.2025 | € | 2.700 | | 2.925 | 0,30 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | $ | 4.400 | | 3.873 | 0,40 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 3.500 | | 3.081 | 0,32 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **RCI Banque S.A.** | | | | |
| 0,340 % fällig am 12.04.2021 | € | 2.100 | € 2.109 | 0,22 |
| 0,750 % fällig am 12.01.2022 | | 1.900 | 1.922 | 0,20 |
| 1,625 % fällig am 11.04.2025 | | 3.400 | 3.518 | 0,36 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2036 | DKK | 19 | 3 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | | 70 | 10 | 0,00 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.03.2026 | € | 5.339 | 5.475 | 0,57 |
| 2,000 % fällig am 08.03.2023 | | 4.100 | 4.236 | 0,44 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 6.000 | 6.237 | 0,65 |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | | 1.300 | 1.382 | 0,14 |
| **Sagax AB** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.01.2024 | | 500 | 520 | 0,05 |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | | 2.400 | 2.500 | 0,26 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget Norden AB** | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2025 | | 200 | 204 | 0,02 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 0,468 % fällig am 18.05.2023 | | 4.400 | 4.345 | 0,45 |
| 0,505 % fällig am 27.03.2024 | | 2.500 | 2.458 | 0,25 |
| 2,875 % fällig am 05.08.2021 | $ | 10.400 | 9.150 | 0,95 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 12.04.2021 | € | 400 | 433 | 0,04 |
| **Scentre Group Trust** | | | | |
| 1,500 % fällig am 16.07.2020 | | 800 | 810 | 0,08 |
| **SELP Finance SARL** | | | | |
| 1,250 % fällig am 25.10.2023 | | 5.300 | 5.469 | 0,57 |
| **Sparebanken Soer Boligkreditt A/S** | | | | |
| 0,250 % fällig am 22.03.2021 | | 3.300 | 3.338 | 0,35 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 02.07.2027 (a) | | 1.300 | 1.304 | 0,14 |
| **TLG Immobilien AG** | | | | |
| 1,375 % fällig am 27.11.2024 | | 800 | 817 | 0,08 |
| 1,500 % fällig am 28.05.2026 | | 2.100 | 2.102 | 0,22 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 0,375 % fällig am 25.04.2024 | | 3.400 | 3.422 | 0,35 |
| 2,250 % fällig am 15.03.2021 | $ | 2.800 | 2.466 | 0,26 |
| **UBS AG** | | | | |
| 0,190 % fällig am 10.01.2020 | € | 3.500 | 3.508 | 0,36 |
| 2,450 % fällig am 01.12.2020 | $ | 1.200 | 1.056 | 0,11 |
| 3,000 % fällig am 01.12.2020 | | 2.400 | 2.115 | 0,22 |
| 4,750 % fällig am 12.02.2026 (e) | € | 1.900 | 2.031 | 0,21 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (e) | $ | 3.000 | 2.956 | 0,31 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.04.2025 | € | 15.400 | 16.007 | 1,66 |
| **UniCredit Bank AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 05.07.2022 (a) | $ | 11.000 | 9.621 | 1,00 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 3,750 % fällig am 12.04.2022 | | 5.700 | 5.066 | 0,53 |
| 6,572 % fällig am 14.01.2022 | | 700 | 654 | 0,07 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 27.10.2022 | € | 2.150 | 2.311 | 0,24 |
| **Virgin Money PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.04.2020 | £ | 4.200 | 4.730 | 0,49 |
| **VIVAT NV** | | | | |
| 2,375 % fällig am 17.05.2024 | € | 3.500 | 3.718 | 0,39 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,159 % fällig am 01.08.2022 | | 2.400 | 2.443 | 0,25 |
| 1,250 % fällig am 10.06.2024 | | 2.300 | 2.350 | 0,24 |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 1.100 | 1.154 | 0,12 |
| 2,500 % fällig am 31.07.2026 | | 600 | 651 | 0,07 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,375 % fällig am 12.04.2021 | | 300 | 302 | 0,03 |
| 0,489 % fällig am 15.02.2021 | | 1.800 | 1.810 | 0,19 |
| 0,875 % fällig am 12.04.2023 | | 800 | 811 | 0,08 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2024 | | 1.400 | 1.443 | 0,15 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 0,500 % fällig am 20.06.2022 | | 1.000 | 1.005 | 0,10 |
| 1,375 % fällig am 20.01.2025 | | 5.700 | 5.853 | 0,61 |
| 1,500 % fällig am 19.06.2026 | | 2.500 | 2.529 | 0,26 |
| 2,625 % fällig am 15.01.2024 | | 5.100 | 5.531 | 0,57 |
| **WEA Finance LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 17.09.2024 | $ | 2.100 | 1.926 | 0,20 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 02.06.2025 | € | 12.400 | 13.334 | 1,38 |
| 2,000 % fällig am 27.04.2026 | | 1.200 | 1.321 | 0,14 |
| 3,500 % fällig am 08.03.2022 | $ | 500 | 452 | 0,05 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.04.2027 | € | 100 | € 105 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 09.04.2026 | | 3.200 | 3.417 | 0,35 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | |
| 1,250 % fällig am 11.06.2021 | | 300 | 309 | 0,03 |
| | | | 514.317 | 53,30 |

**INDUSTRIEWERTE**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 31.07.2043 | £ | 4.036 | 4.304 | 0,45 |
| 4,249 % fällig am 31.07.2043 | | 100 | 114 | 0,01 |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 18.11.2019 | € | 1.200 | 1.202 | 0,12 |
| **Ahlstrom-Munksjo Oyj** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.06.2022 | | 1.900 | 1.930 | 0,20 |
| **Allergan Funding SCS** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.06.2021 | | 1.100 | 1.109 | 0,11 |
| 1,250 % fällig am 01.06.2024 | | 2.900 | 2.980 | 0,31 |
| **Altria Group, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.02.2023 | | 500 | 512 | 0,05 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 25.02.2026 | | 600 | 667 | 0,07 |
| **Anheuser-Busch InBev S.A.** | | | | |
| 0,432 % fällig am 17.03.2020 | | 1.400 | 1.407 | 0,15 |
| 0,625 % fällig am 17.03.2020 | | 300 | 302 | 0,03 |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.03.2026 | | 2.100 | 2.154 | 0,22 |
| **Australia Pacific Airports Melbourne Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 26.09.2023 | | 1.500 | 1.691 | 0,18 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2023 | | 3.100 | 3.318 | 0,34 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 19.01.2023 | | 200 | 214 | 0,02 |
| 2,750 % fällig am 25.03.2025 | | 570 | 625 | 0,06 |
| 3,950 % fällig am 15.06.2025 | $ | 5.430 | 4.940 | 0,51 |
| **BEL SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 18.04.2024 | € | 3.700 | 3.730 | 0,39 |
| **Borealis AG** | | | | |
| 1,750 % fällig am 10.12.2025 | | 2.100 | 2.245 | 0,23 |
| **Bureau Veritas S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 07.09.2023 | | 5.300 | 5.385 | 0,56 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | $ | 1.900 | 1.684 | 0,17 |
| **Christian Dior SE** | | | | |
| 0,750 % fällig am 24.06.2021 | € | 200 | 202 | 0,02 |
| **Continental AG** | | | | |
| 0,000 % fällig am 05.02.2020 (b) | | 300 | 300 | 0,03 |
| **CRH Funding BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.01.2024 | | 350 | 377 | 0,04 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 09.03.2023 | $ | 2.200 | 1.999 | 0,21 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2020 | | 100 | 88 | 0,01 |
| **Daimler International Finance BV** | | | | |
| 0,250 % fällig am 09.08.2021 | € | 1.600 | 1.610 | 0,17 |
| **Davide Campari-Milano SpA** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.09.2020 | | 1.979 | 2.041 | 0,21 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2024 | $ | 7.600 | 6.853 | 0,71 |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 400 | 362 | 0,04 |
| **DP World PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.09.2026 | € | 400 | 420 | 0,04 |
| **easyJet PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.02.2023 | | 2.700 | 2.824 | 0,29 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.07.2022 | $ | 1.900 | 1.673 | 0,17 |
| **El Paso Natural Gas Co. LLC** | | | | |
| 8,625 % fällig am 15.01.2022 | | 1.505 | 1.514 | 0,16 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | | 200 | 179 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 15.04.2024 | | 100 | 94 | 0,01 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | | 1.000 | 903 | 0,09 |
| **Eurofins Scientific SE** | | | | |
| 2,125 % fällig am 25.07.2024 (f) | € | 1.100 | 1.100 | 0,11 |
| 2,250 % fällig am 27.01.2022 | € | 100 | € 102 | 0,01 |
| 3,375 % fällig am 30.01.2023 (f) | | 3.900 | 4.058 | 0,42 |
| **Experian Finance PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.02.2020 | | 400 | 412 | 0,04 |
| **Ferrovial Emisiones S.A.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 31.03.2025 | | 1.700 | 1.787 | 0,18 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 0,400 % fällig am 15.01.2021 | | 2.000 | 2.016 | 0,21 |
| 0,750 % fällig am 21.05.2023 | | 300 | 306 | 0,03 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 01.07.2027 (a) | | 200 | 203 | 0,02 |
| 1,625 % fällig am 01.07.2030 (a) | | 500 | 512 | 0,05 |
| **Flex Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2023 | $ | 100 | 92 | 0,01 |
| **Fonterra Co-operative Group Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 08.11.2024 | € | 2.800 | 2.844 | 0,29 |
| **G4S International Finance PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 09.01.2023 | | 3.600 | 3.671 | 0,38 |
| 1,500 % fällig am 02.06.2024 | | 800 | 815 | 0,08 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 26.05.2023 | | 2.950 | 3.046 | 0,32 |
| 1,500 % fällig am 17.05.2029 | | 135 | 134 | 0,01 |
| **General Motors Co.** | | | | |
| 3,365 % fällig am 07.08.2020 | $ | 1.200 | 1.055 | 0,11 |
| **Hochtief AG** | | | | |
| 3,875 % fällig am 20.03.2020 | € | 400 | 411 | 0,04 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.08.2023 | | 3.100 | 3.165 | 0,33 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 05.07.2023 | | 1.300 | 1.351 | 0,14 |
| **Ingenico Group S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 13.09.2024 | | 5.800 | 5.785 | 0,60 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2027 | | 2.100 | 2.234 | 0,23 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 25.09.2021 | | 500 | 506 | 0,05 |
| **ITV PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 21.09.2022 | | 4.900 | 5.107 | 0,53 |
| **Johnson & Johnson** | | | | |
| 0,250 % fällig am 20.01.2022 | | 200 | 203 | 0,02 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.04.2020 | $ | 400 | 361 | 0,04 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.05.2024 | € | 1.200 | 1.244 | 0,13 |
| 2,000 % fällig am 30.06.2023 | | 3.900 | 4.129 | 0,43 |
| **Leonardo SpA** | | | | |
| 8,000 % fällig am 16.12.2019 | £ | 700 | 806 | 0,08 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.12.2023 | | 400 | 458 | 0,05 |
| **Medtronic Global Holdings S.C.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.12.2022 (a)(b) | € | 2.700 | 2.704 | 0,28 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.12.2030 | $ | 620 | 509 | 0,05 |
| 5,965 % fällig am 15.12.2025 | £ | 38 | 46 | 0,00 |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | | 129 | 164 | 0,02 |
| **Molnlycke Holding AB** | | | | |
| 1,875 % fällig am 28.02.2025 | € | 2.100 | 2.221 | 0,23 |
| **Mondi Finance PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.04.2024 | | 1.700 | 1.792 | 0,19 |
| 3,375 % fällig am 28.09.2020 | | 1.600 | 1.667 | 0,17 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | |
| 0,375 % fällig am 03.01.2026 (a) | | 3.100 | 3.109 | 0,32 |
| 0,875 % fällig am 14.03.2025 | | 800 | 830 | 0,09 |
| 1,625 % fällig am 09.06.2023 | | 800 | 855 | 0,09 |
| **Mylan NV** | | | | |
| 3,125 % fällig am 22.11.2028 | | 8.500 | 8.815 | 0,91 |
| **NorteGas Energia Distribucion S.A.U.** | | | | |
| 2,065 % fällig am 28.09.2027 | | 300 | 319 | 0,03 |
| **PerkinElmer, Inc.** | | | | |
| 0,600 % fällig am 09.04.2021 | | 2.500 | 2.524 | 0,26 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 4,750 % fällig am 26.02.2029 | | 1.800 | 1.726 | 0,18 |
| **Philip Morris International, Inc.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 03.03.2021 | | 2.300 | 2.378 | 0,25 |
| 2,750 % fällig am 19.03.2025 | | 3.100 | 3.527 | 0,37 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ProSiebenSat.1 Media SE** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2021 | € | 5.700 | € 5.909 | 0,61 |
| **RELX Finance BV** | | | | |
| 0,375 % fällig am 22.03.2021 | | 1.600 | 1.614 | 0,17 |
| **Ryanair DAC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.06.2021 | | 2.400 | 2.487 | 0,26 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | $ | 400 | 365 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 30.06.2026 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Safran S.A.** | | | | |
| 0,227 % fällig am 28.06.2021 | € | 1.500 | 1.500 | 0,16 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | | 6.700 | 6.946 | 0,72 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 31.05.2024 | | 2.200 | 2.275 | 0,24 |
| 2,375 % fällig am 25.11.2022 | | 900 | 959 | 0,10 |
| **Sky Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.09.2021 | | 3.600 | 3.729 | 0,39 |
| **Societa Esercizi Aereoportuali SpA Sea** | | | | |
| 3,125 % fällig am 17.04.2021 | | 2.400 | 2.499 | 0,26 |
| **Stryker Corp.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 30.11.2023 | | 1.100 | 1.151 | 0,12 |
| 2,125 % fällig am 30.11.2027 | | 1.000 | 1.125 | 0,12 |
| **Swedish Match AB** | | | | |
| 1,200 % fällig am 10.11.2025 | | 1.300 | 1.284 | 0,13 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | $ | 500 | 457 | 0,05 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 4.500 | 4.127 | 0,43 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | |
| 0,237 % fällig am 21.11.2020 | € | 3.900 | 3.916 | 0,41 |
| 0,787 % fällig am 21.11.2022 | | 1.500 | 1.530 | 0,16 |
| 1,125 % fällig am 21.11.2022 | | 1.000 | 1.035 | 0,11 |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026 | | 1.700 | 1.885 | 0,20 |
| 3,000 % fällig am 21.11.2030 | | 100 | 116 | 0,01 |
| **Tauron Polska Energia S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 05.07.2027 | | 2.500 | 2.570 | 0,27 |
| **TDF Infrastructure S.A.S.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 19.10.2022 | | 7.800 | 8.303 | 0,86 |
| **Teleperformance** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.07.2025 | | 1.000 | 1.054 | 0,11 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.10.2023 | | 800 | 829 | 0,09 |
| **Tesco PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | £ | 75 | 94 | 0,01 |
| **Transurban Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.08.2025 | € | 1.600 | 1.744 | 0,18 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | |
| 1,289 % fällig am 30.01.2023 | | 3.900 | 3.964 | 0,41 |
| **UCB S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.04.2022 | | 3.200 | 3.332 | 0,35 |
| 3,750 % fällig am 27.03.2020 | | 200 | 205 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 04.01.2021 | | 2.200 | 2.333 | 0,24 |
| **United Technologies Corp.** | | | | |
| 1,150 % fällig am 18.05.2024 | | 500 | 521 | 0,05 |
| **Viterra, Inc.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 01.08.2020 | $ | 1.475 | 1.339 | 0,14 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | | 200 | 177 | 0,02 |
| **WestJet Airlines Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 16.06.2021 | | 400 | 353 | 0,04 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 27.04.2023 | € | 700 | 740 | 0,08 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 1,414 % fällig am 13.12.2022 | | 7.200 | 7.468 | 0,77 |
| | | | 223.086 | 23,12 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **BP Capital Markets PLC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 19.09.2024 | | 1.200 | 1.242 | 0,13 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 26.09.2023 | | 2.000 | 2.053 | 0,21 |
| 1,000 % fällig am 23.06.2024 | | 900 | 929 | 0,10 |
| 1,000 % fällig am 21.11.2024 | | 2.300 | 2.373 | 0,25 |
| 1,750 % fällig am 10.03.2026 | | 500 | 535 | 0,06 |
| **CNOOC Finance Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 09.05.2023 | $ | 200 | 177 | 0,02 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 25.05.2022 | $ | 800 | € 708 | 0,07 |
| **Engie S.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 10.10.2022 | | 1.700 | 1.525 | 0,16 |
| **Eutelsat S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.07.2027 | € | 3.800 | 3.881 | 0,40 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | | 2.100 | 2.253 | 0,23 |
| **Global Switch Holdings Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 31.01.2024 | | 900 | 929 | 0,10 |
| **SPP-Distribucia A/S** | | | | |
| 2,625 % fällig am 23.06.2021 | | 2.200 | 2.309 | 0,24 |
| **Tele2 AB** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2028 | | 400 | 431 | 0,04 |
| **Telenor ASA** | | | | |
| 0,750 % fällig am 31.05.2026 | | 1.200 | 1.237 | 0,13 |
| **Teollisuuden Voima Oyj** | | | | |
| 2,000 % fällig am 08.05.2024 | | 400 | 418 | 0,04 |
| **Transmission Finance DAC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.05.2023 | | 500 | 526 | 0,05 |
| **Zapadoslovenska Energetika A/S** | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.03.2028 | | 600 | 649 | 0,07 |
| | | | 22.175 | 2,30 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 759.578 | 78,72 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | $ | 79.800 | 71.625 | 7,42 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,547 % fällig am 25.08.2034 ^ | | 67 | 56 | 0,01 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,946 % fällig am 10.06.2044 | £ | 51 | 56 | 0,01 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 2,532 % fällig am 18.06.2039 | $ | 646 | 553 | 0,06 |
| **Landmark Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,107 % fällig am 17.04.2044 | £ | 1.286 | 1.347 | 0,14 |
| **Mulcair Securities DAC** | | | | |
| 0,695 % fällig am 24.04.2071 | € | 2.500 | 2.505 | 0,26 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 0,282 % fällig am 15.12.2050 | | 287 | 278 | 0,03 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 0,943 % fällig am 12.06.2044 | £ | 135 | 143 | 0,01 |
| **Southern Pacific Financing PLC** | | | | |
| 0,946 % fällig am 10.03.2044 | | 100 | 110 | 0,01 |
| 0,966 % fällig am 10.06.2043 | | 62 | 69 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 3,090 % fällig am 19.12.2034 | $ | 150 | 135 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 3.400 | 3.814 | 0,39 |
| | | | 9.066 | 0,94 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accunia European CLO BV** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 3.400 | 3.406 | 0,35 |
| **Adagio CLO Ltd.** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2029 | | 1.700 | 1.706 | 0,18 |
| **Apex Credit CLO Ltd.** | | | | |
| 3,632 % fällig am 27.10.2028 | $ | 500 | 440 | 0,05 |
| **Arbour CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 15.07.2027 | € | 1.684 | 1.684 | 0,17 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Babson Euro CLO BV** | | | | |
| 0,509 % fällig am 25.10.2029 | | 2.600 | 2.590 | 0,27 |
| **Barings Euro CLO BV** | | | | |
| 0,680 % fällig am 27.07.2030 | | 3.200 | 3.193 | 0,33 |
| **Black Diamond CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | | 1.100 | 1.101 | 0,11 |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | | 3.500 | 3.504 | 0,36 |
| 0,930 % fällig am 30.04.2031 | | 600 | 602 | 0,06 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 21.09.2029 | € | 400 | € 400 | 0,04 |
| 0,870 % fällig am 18.01.2030 | | 1.700 | 1.700 | 0,18 |
| 1,200 % fällig am 21.09.2029 | | 300 | 303 | 0,03 |
| **CVC Cordatus Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 0,970 % fällig am 22.04.2030 | | 4.200 | 4.218 | 0,44 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | |
| 1,300 % fällig am 28.04.2029 | | 200 | 200 | 0,02 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 15.07.2030 | | 2.400 | 2.389 | 0,25 |
| 0,880 % fällig am 15.01.2030 | | 1.600 | 1.602 | 0,17 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | | 3.500 | 3.501 | 0,36 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Euro-Galaxy CLO BV** | | | | |
| 1,140 % fällig am 10.11.2030 | | 2.100 | 2.102 | 0,22 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | | 2.200 | 2.202 | 0,23 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 1.600 | 1.600 | 0,17 |
| 1,100 % fällig am 18.11.2029 | | 250 | 250 | 0,03 |
| **Holland Park CLO Ltd.** | | | | |
| 0,621 % fällig am 14.05.2027 | | 1.926 | 1.927 | 0,20 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | | 1.800 | 1.796 | 0,19 |
| **North Westerly CLO BV** | | | | |
| 0,644 % fällig am 15.01.2026 | | 2.331 | 2.332 | 0,24 |
| 1,250 % fällig am 15.01.2026 | | 243 | 243 | 0,02 |
| **Penta CLO BV** | | | | |
| 0,790 % fällig am 04.08.2028 | | 500 | 500 | 0,05 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.01.2024 | | 82 | 82 | 0,01 |
| **Sorrento Park CLO DAC** | | | | |
| 0,639 % fällig am 16.11.2027 | | 2.031 | 2.033 | 0,21 |
| **St Paul's CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 20.08.2030 | | 3.600 | 3.603 | 0,37 |
| **THL Credit Wind River CLO Ltd.** | | | | |
| 4,047 % fällig am 15.01.2026 | $ | 2.594 | 2.278 | 0,24 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,600 % fällig am 04.08.2028 | € | 1.100 | 1.099 | 0,11 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 15.10.2030 | | 3.600 | 3.609 | 0,37 |
| | | | 58.295 | 6,04 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.03.2021 | $ | 4.800 | 4.270 | 0,44 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | € | 100 | 108 | 0,01 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 700 | 720 | 0,08 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.03.2024 | $ | 1.700 | 1.545 | 0,16 |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | | 2.600 | 2.397 | 0,25 |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 4,625 % fällig am 03.04.2049 | € | 1.500 | 1.818 | 0,19 |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 04.12.2025 | | 300 | 322 | 0,03 |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 26.10.2021 | $ | 700 | 614 | 0,06 |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 200 | 178 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 3.700 | 3.463 | 0,36 |
| | | | 15.435 | 1,60 |

| | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **AKTIEN** | | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (d)** | | 843.790 | 84.565 | 8,76 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (g)** | | | 4.278 | 0,44 |
| **GREECE TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,556 % fällig am 04.10.2019 (b)(c) | € | 1.000 | € 999 | 0,10 |
| 0,587 % fällig am 04.10.2019 (b)(c) | | 4.300 | 4.297 | 0,45 |
| 0,618 % fällig am 30.08.2019 (b)(c) | | 1.900 | 1.899 | 0,20 |
| 0,729 % fällig am 30.08.2019 (b)(c) | | 1.700 | 1.699 | 0,18 |
| 0,414 % fällig am 06.12.2019 (b)(c) | | 400 | 400 | 0,04 |
| | | | 9.294 | 0,97 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 13.572 | 1,41 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | € 1.026.222 | 106,35 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09/2019 | 679 | € 394 | 0,04 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09/2019 | 92 | 9 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 1.080 | 2.557 | 0,27 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 94 | 520 | 0,05 |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09/2019 | 511 | 82 | 0,01 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 68 | (177) | (0,02) |
| | | | | € 3.385 | 0,35 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 126,500 | 26.07.2019 | 68 | € (15) | € (8) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 68 | (14) | (16) | 0,00 |
| | | | | € (29) | € (24) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **€ 3.361** | **0,35** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 14.400 | € 66 | 0,01 |
| Daimler AG | 1,000 | 20.12.2020 | € 900 | (1) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.06.2023 | $ 900 | (12) | 0,00 |
| Glencore Finance | 5,000 | 20.06.2024 | € 4.000 | 1 | 0,00 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2022 | 1.900 | 20 | 0,00 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2023 | 1.800 | 3 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2024 | 6.100 | 54 | 0,01 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 400 | (2) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A.U. | 1,000 | 20.12.2023 | 7.300 | 164 | 0,01 |
| Telefonica Emisiones S.A.U. | 1,000 | 20.06.2024 | 700 | 4 | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.12.2023 | 4.800 | 66 | 0,01 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2024 | 2.900 | 26 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.06.2024 | 2.600 | 7 | 0,00 |
| | | | | € 396 | 0,04 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 3.000 | € 32 | 0,00 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 68.400 | 237 | 0,03 |
| | | | | € 269 | 0,03 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 20.06.2048 | $ 10.200 | € (1.576) | (0,16) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 7.400 | (593) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2021 | 97.600 | (830) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 5.100 | (49) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 2.600 | (336) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2049 | 2.700 | (322) | (0,03) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 18.12.2049 | 1.300 | 4 | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | € 35.800 | 1.724 | 0,18 |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | £ 12.200 | (255) | (0,03) |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 500 | (45) | 0,00 |
| | | | | | € (2.278) | (0,24) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (1.613)** | **(0,17)** |

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

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

[3] Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 % | 21.08.2019 | 2.000 | € (2) | € 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 2.800 | (2) | (1) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 3.600 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 3.500 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 800 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 2.900 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 2.100 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 18.09.2019 | 4.000 | (7) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 8.000 | (14) | (2) | (0,00) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 6.300 | (10) | (2) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 10.500 | (17) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 2.300 | (3) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 2.000 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 2.400 | (3) | (1) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 2.300 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,900 | 17.06.2020 | 14.500 | (12) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 4.300 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 2.600 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 3.400 | (6) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 8.600 | (12) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 3,000 | 17.06.2020 | 14.500 | (13) | (3) | 0,00 |
| JLN | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 18.09.2019 | 4.000 | (7) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.100 | (1) | 0 | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 1.800 | (3) | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.900 | (2) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | € (143) | € (26) | (0,00) |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,650 % | 12.07.2019 | 10.600 | € (17) | € (12) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,000 | 12.07.2019 | 10.600 | (17) | (2) | 0,00 |
| FBF | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,130 | 05.07.2019 | 5.400 | (13) | (70) | (0,01) |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,640 | 19.07.2019 | 10.600 | (20) | (16) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,000 | 19.07.2019 | 10.600 | (17) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | | € (84) | € (103) | (0,01) |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Hammerson PLC | 1,000 % | 20.12.2022 | € 200 | € 2 | € 0 | € 2 | 0,00 |
| BRC | Hammerson PLC | 1,000 | 20.12.2022 | 400 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| CBK | Heathrow Funding Ltd. | 1,000 | 20.06.2021 | 1.000 | 3 | 10 | 13 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | $ 700 | (11) | 8 | (3) | 0,00 |
| GST | Hammerson PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 2.300 | 11 | 8 | 19 | 0,01 |
| | Heathrow Funding Ltd. | 1,000 | 20.06.2021 | 800 | 3 | 7 | 10 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | $ 400 | (3) | 5 | 2 | 0,00 |
| HUS | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2024 | 2.400 | (16) | 14 | (2) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 300 | (4) | 4 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 500 | (7) | 5 | (2) | 0,00 |
| JPM | Heathrow Funding Ltd. | 1,000 | 20.06.2021 | € 500 | 2 | 5 | 7 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | $ 100 | (1) | 0 | (1) | 0,00 |
| | | | | | € (18) | € 66 | € 48 | 0,01 |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 11.128 | € | 9.838 | € 66 | € 0 | € 66 | 0,01 |
| | 09/2019 | CNH | 35.215 | $ | 5.078 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 6.978 | | 5.098 | 0 | (57) | (57) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 1.910 | KRW | 2.208.937 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 2.548 | TWD | 78.509 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | DKK | 50.360 | € | 6.744 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 11.044 | $ | 12.571 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.310 | € | 1.152 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | ARS | 408 | $ | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 4.115 | € | 4.723 | 131 | 0 | 131 | 0,01 |
| | 09/2019 | KRW | 6.050.318 | $ | 5.103 | 0 | (117) | (117) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 5.079 | CNH | 34.936 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 2.550 | TWD | 78.502 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | € | 194.533 | $ | 221.087 | 0 | (393) | (393) | (0,04) |
| | 08/2019 | $ | 221.651 | € | 194.533 | 394 | 0 | 394 | 0,04 |
| GLM | 07/2019 | € | 2.977 | $ | 3.366 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 08/2019 | RUB | 147.211 | | 2.236 | 0 | (68) | (68) | (0,01) |
| HUS | 09/2019 | $ | 5.099 | SGD | 6.914 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 92.420 | $ | 2.952 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | DKK | 62.340 | € | 8.356 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 3.294 | KRW | 3.805.427 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 29.693 | $ | 946 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | DKK | 69.105 | € | 9.263 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| RBC | 09/2019 | $ | 0 | KRW | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 3.025 | € | 2.696 | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.275 | RUB | 150.896 | 99 | 0 | 99 | 0,01 |
| | 08/2019 | £ | 33.076 | € | 38.202 | 1.291 | 0 | 1.291 | 0,12 |
| | 08/2019 | ¥ | 37.700 | | 306 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 37.052 | $ | 1.184 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ | 219.191 | € | 196.020 | 3.545 | 0 | 3.545 | 0,37 |
| UAG | 07/2019 | € | 24.261 | DKK | 181.114 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 181.114 | € | 24.274 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | | | | | | € 5.598 | € (797) | € 4.801 | 0,49 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ 4.720** | **0,49** |
| **Summe Anlagen** | **€ 1.032.690** | **107,02** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **€ (67.710)** | **(7,02)** |
| **Nettovermögen** | **€ 964.980** | **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) Mit dem Fonds verbunden.**

**(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 3.601 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von EUR 19.263 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**(g) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (0,580) % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | € 2.900 | SNCF Reseau 3,300 % fällig am 18.12.2042 | € (2.815) | € 2.900 | € 2.900 | 0,30 |
| FICC | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 1.569 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | (1.406) | 1.378 | 1.378 | 0,14 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (4.221)** | **€ 4.278** | **€ 4.278** | **0,44** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 84.565 | € 941.657 | € 0 | € 1.026.222 |
| Finanzderivate[3] | 3.361 | 3.107 | 0 | 6.468 |
| **Summen** | **€ 87.926** | **€ 944.764** | **€ 0** | **€ 1.032.690** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 47.415 | € 724.597 | € 0 | € 772.012 |
| Finanzderivate[3] | 2.446 | (1.755) | 0 | 691 |
| **Summen** | **€ 49.861** | **€ 722.842** | **€ 0** | **€ 772.703** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| CFR | (3,450) % | 25.03.2019 | TBD[1] | € (997) | € (988) | (0,10) |
| | (3,000) | 15.02.2019 | TBD[1] | (2.028) | (2.005) | (0,21) |
| JML | (3,800) | 09.05.2019 | TBD[1] | (529) | (525) | (0,05) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **€ (3.518)** | **(0,36)** |

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (47) | € 0 | € (47) |
| BPS | 4 | 0 | 4 |
| BRC | (3) | 0 | (3) |
| CBK | 11 | 0 | 11 |
| CKL | (4) | 0 | (4) |
| DUB | (2) | 0 | (2) |
| FBF | (70) | 0 | (70) |
| GLM | (108) | 0 | (108) |
| GST | 21 | 0 | 21 |
| HUS | (33) | 0 | (33) |
| JLN | (1) | 0 | (1) |
| JPM | (7) | 0 | (7) |
| MYI | 4 | 0 | 4 |
| SCX | 1.411 | (1.350) | 61 |
| TOR | 3.545 | (3.346) | 199 |
| UAG | (1) | 0 | (1) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 91,79 | 89,60 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 14,41 | 12,05 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,15 | 2,39 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,35 | 0,33 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,17) | (0,38) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,49 | 0,14 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,36) | (0,36) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 1,46 | 1,87 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 78,72 | 77,23 |
| US-Regierungsbehörden | 7,42 | 6,48 |
| Non-Agency-MBS | 0,94 | 0,39 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 6,04 | 6,90 |
| Staatsemissionen | 1,60 | 1,53 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 8,76 | 6,39 |
| Kurzfristige Instrumente | 1,41 | 3,25 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,35 | 0,33 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,04 | (0,08) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,03 | (0,08) |
| Zinsswaps | (0,24) | (0,22) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,00) | (0,01) |
| Zinsswapoption | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,01 | (0,02) |
| Devisenterminkontrakte | 0,49 | 0,17 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (7,02) | (4,13) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **Altice Financing S.A.** | | | | | |
| 5,144 % fällig am 31.01.2026 | $ | 1.281 | € | 1.074 | 0,05 |
| **Altice France S.A.** | | | | | |
| 6,394 % fällig am 14.08.2026 | | 2.992 | | 2.579 | 0,12 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 4,330 % fällig am 30.04.2025 | | 4.384 | | 3.849 | 0,17 |
| **Crown Americas LLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 03.04.2025 | € | 1.386 | | 1.399 | 0,06 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 4,410 % fällig am 07.09.2023 | $ | 1.353 | | 1.183 | 0,05 |
| **Grifols Worldwide Operations USA, Inc.** | | | | | |
| 4,635 % fällig am 31.01.2025 | | 3.428 | | 3.005 | 0,14 |
| **HCA, Inc.** | | | | | |
| 4,330 % fällig am 13.03.2025 | | 4.726 | | 4.158 | 0,19 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | | |
| 4,154 % fällig am 25.10.2023 | | 3.798 | | 3.340 | 0,15 |
| **Ineos Finance LLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 31.03.2024 | € | 14.132 | | 14.087 | 0,64 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | | |
| 4,652 % fällig am 22.02.2024 | $ | 3.171 | | 2.765 | 0,12 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | | | |
| 4,412 % fällig am 04.10.2023 | | 4.814 | | 4.192 | 0,19 |
| **Numericable Group S.A.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.01.2026 | € | 6.160 | | 5.972 | 0,27 |
| 5,152 % fällig am 31.07.2025 | $ | 1.696 | | 1.422 | 0,06 |
| 6,082 % fällig am 31.01.2026 | | 9.230 | | 7.882 | 0,36 |
| **PCF GmbH** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | € | 6.400 | | 6.267 | 0,28 |
| **Perstorp Holding AB** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 31.03.2026 | | 4.000 | | 3.997 | 0,18 |
| **SIG Combibloc Holdings S.C.A.** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 02.10.2025 | | 2.000 | | 2.013 | 0,09 |
| **Sigma Bidco BV** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.07.2025 | | 7.000 | | 6.866 | 0,31 |
| **State Of Qatar** | | | | | |
| 2,983 % fällig am 21.12.2020 | $ | 5.000 | | 4.380 | 0,20 |
| **TDC A/S** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 04.06.2025 | € | 5.736 | | 5.745 | 0,26 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2027 | | 9.000 | | 9.011 | 0,41 |
| **Virgin Media Bristol LLC** | | | | | |
| 4,894 % fällig am 15.01.2026 | $ | 5.100 | | 4.468 | 0,20 |
| **Ziggo Secured Finance BV** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.04.2025 | € | 6.300 | | 6.297 | 0,28 |
| **Ziggo Secured Finance Partnership** | | | | | |
| 4,894 % fällig am 15.04.2025 | $ | 5.100 | | 4.395 | 0,20 |
| | | | | 110.346 | 4,98 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € | 6.700 | | 6.783 | 0,31 |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 28.07.2025 | $ | 4.222 | | 3.982 | 0,18 |
| **ADLER Real Estate AG** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 27.04.2026 | € | 10.700 | | 11.128 | 0,50 |
| **Aegon Bank NV** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2024 | | 1.000 | | 1.008 | 0,05 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | | |
| 4,450 % fällig am 16.12.2021 | $ | 750 | | 684 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2021 | | 3.000 | | 2.764 | 0,12 |
| **AIB Group PLC** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 29.03.2023 | € | 4.500 | | 4.629 | 0,21 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | $ | 2.600 | | 2.289 | 0,10 |
| **Altareit S.C.A.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 02.07.2025 | € | 10.900 | | 11.381 | 0,51 |
| **American Tower Corp.** | | | | | |
| 1,950 % fällig am 22.05.2026 | | 4.000 | | 4.276 | 0,19 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.07.2024 | € | 4.400 | € | 4.592 | 0,21 |
| 2,000 % fällig am 02.11.2026 | | 6.800 | | 7.155 | 0,32 |
| 2,125 % fällig am 13.03.2023 | | 4.200 | | 4.473 | 0,20 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | | 6.196 | | 6.644 | 0,30 |
| **Aviva PLC** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 13.11.2027 | | 4.000 | | 4.279 | 0,19 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 29.01.2024 | | 10.300 | | 10.642 | 0,48 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (f)(h) | | 6.000 | | 6.177 | 0,28 |
| 8,875 % fällig am 14.04.2021 (f)(h) | | 7.200 | | 8.037 | 0,36 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (f)(h) | | 1.400 | | 1.475 | 0,07 |
| **Bank of America Corp.** | | | | | |
| 0,808 % fällig am 09.05.2026 | | 7.100 | | 7.200 | 0,33 |
| **Bank of Ireland** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (f)(h) | | 2.600 | | 2.749 | 0,12 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 29.08.2023 | | 4.800 | | 4.909 | 0,22 |
| **Bankinter S.A.** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 08.07.2026 (b) | | 2.000 | | 1.998 | 0,09 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | $ | 2.245 | | 2.154 | 0,10 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 4.570 | | 5.874 | 0,27 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 3,650 % fällig am 16.03.2025 | $ | 10.700 | | 9.464 | 0,43 |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | | 3.700 | | 3.363 | 0,15 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | € | 19.000 | | 19.236 | 0,87 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | £ | 200 | | 226 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (f)(h) | € | 4.900 | | 5.310 | 0,24 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.02.2024 | | 2.200 | | 2.309 | 0,10 |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | | 4.100 | | 4.337 | 0,20 |
| **BNP Paribas Cardif S.A.** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 29.11.2024 | | 400 | | 403 | 0,02 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | $ | 700 | | 667 | 0,03 |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 32.800 | | 30.920 | 1,40 |
| **BPCE S.A.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 22.05.2022 | | 1.500 | | 1.330 | 0,06 |
| 5,700 % fällig am 22.10.2023 | | 3.900 | | 3.750 | 0,17 |
| **Bureau Veritas S.A.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 06.01.2025 | € | 5.900 | | 6.137 | 0,28 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | | 4.700 | | 4.909 | 0,22 |
| **Castellum AB** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | | 100 | | 106 | 0,00 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (f)(h) | | 900 | | 938 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (f)(h) | | 3.000 | | 3.328 | 0,15 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 (i) | | 9.900 | | 9.923 | 0,45 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | | 5.700 | | 5.847 | 0,26 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 2.400 | | 2.184 | 0,10 |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.09.2021 | € | 1.200 | | 1.230 | 0,06 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2021 | | 2.800 | | 2.892 | 0,13 |
| 5,750 % fällig am 18.09.2025 (h) | | 1.000 | | 1.065 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | $ | 11.200 | | 10.849 | 0,49 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.07.2025 | € | 7.000 | | 7.266 | 0,33 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | $ | 1.550 | | 1.422 | 0,06 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 0,180 % fällig am 07.12.2020 | € | 8.100 | | 8.009 | 0,36 |
| 0,327 % fällig am 10.09.2021 | | 1.600 | | 1.565 | 0,07 |
| 1,500 % fällig am 20.01.2022 | | 7.500 | | 7.544 | 0,34 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 100 | | 101 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2020 | £ | 400 | | 447 | 0,02 |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | € | 9.000 | | 9.138 | 0,41 |
| 3,375 % fällig am 12.05.2021 | $ | 6.500 | | 5.685 | 0,26 |
| 3,875 % fällig am 12.02.2024 | £ | 400 | | 459 | 0,02 |
| 4,250 % fällig am 04.02.2021 | $ | 1.700 | | 1.506 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 5.700 | | 5.076 | 0,23 |
| 5,000 % fällig am 14.02.2022 | | 2.700 | | 2.445 | 0,11 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 15.09.2021 | $ | 300 | € | 263 | 0,01 |
| 2,375 % fällig am 20.09.2022 | | 3.700 | | 3.283 | 0,15 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | € | 4.700 | | 5.135 | 0,23 |
| 2,625 % fällig am 15.04.2024 | | 300 | | 330 | 0,01 |
| **Dream Global Funding SARL** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 21.12.2021 | | 400 | | 407 | 0,02 |
| 1,750 % fällig am 28.06.2026 | | 2.900 | | 2.933 | 0,13 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (d) | | 11.095 | | 10.748 | 0,49 |
| **Equinix, Inc.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.03.2024 | | 7.650 | | 8.015 | 0,36 |
| **Euroclear Bank S.A.** | | | | | |
| 0,040 % fällig am 10.07.2020 | | 2.000 | | 2.005 | 0,09 |
| 0,077 % fällig am 08.03.2021 | | 9.600 | | 9.638 | 0,44 |
| 0,500 % fällig am 10.07.2023 | | 1.200 | | 1.225 | 0,06 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | | 20.500 | | 22.001 | 0,99 |
| **FCE Bank PLC** | | | | | |
| 0,189 % fällig am 26.08.2020 | | 300 | | 299 | 0,01 |
| 0,869 % fällig am 13.09.2021 | | 300 | | 301 | 0,01 |
| 1,875 % fällig am 24.06.2021 | | 600 | | 614 | 0,03 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | | 3.400 | | 3.330 | 0,15 |
| 0,100 % fällig am 07.12.2022 | | 1.100 | | 1.057 | 0,05 |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | | 400 | | 396 | 0,02 |
| 1,514 % fällig am 17.02.2023 | | 3.100 | | 3.122 | 0,14 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | | 2.000 | | 2.121 | 0,10 |
| 3,408 % fällig am 05.04.2021 | $ | 700 | | 607 | 0,03 |
| 3,470 % fällig am 05.04.2021 | | 4.400 | | 3.892 | 0,18 |
| 3,484 % fällig am 12.10.2021 | | 600 | | 519 | 0,02 |
| 3,753 % fällig am 15.02.2023 | | 200 | | 171 | 0,01 |
| 5,584 % fällig am 18.03.2024 | | 600 | | 566 | 0,03 |
| 5,596 % fällig am 07.01.2022 | | 3.000 | | 2.790 | 0,13 |
| 5,729 % fällig am 07.01.2022 | | 300 | | 272 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2021 | | 1.375 | | 1.257 | 0,06 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | | 200 | | 175 | 0,01 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 13.09.2023 | £ | 960 | | 1.159 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 24.05.2023 | | 1.300 | | 1.613 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 04.11.2020 | | 1.540 | | 1.820 | 0,08 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | | |
| 0,207 % fällig am 26.03.2022 | € | 4.500 | | 4.442 | 0,20 |
| 2,200 % fällig am 01.04.2024 | | 200 | | 211 | 0,01 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 20.06.2022 | | 9.500 | | 10.086 | 0,46 |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | | 300 | | 319 | 0,01 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 0,277 % fällig am 26.09.2023 | | 16.400 | | 16.351 | 0,74 |
| 1,375 % fällig am 15.05.2024 | | 9.300 | | 9.643 | 0,44 |
| **Groupe Bruxelles Lambert S.A.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 19.06.2025 | | 700 | | 731 | 0,03 |
| **Hamburg Commercial Bank AG** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 19.11.2020 | | 1.400 | | 1.412 | 0,06 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 06.09.2024 (i) | | 11.800 | | 12.114 | 0,55 |
| **IMMOFINANZ AG** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 27.01.2023 | | 1.000 | | 1.046 | 0,05 |
| **ING Bank NV** | | | | | |
| 0,110 % fällig am 26.11.2021 | | 8.300 | | 8.357 | 0,38 |
| 5,800 % fällig am 25.09.2023 | $ | 300 | | 292 | 0,01 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | | |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | | 4.000 | | 3.525 | 0,16 |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | | 11.200 | | 10.354 | 0,47 |
| **JAB Holdings BV** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 25.06.2026 | € | 1.400 | | 1.474 | 0,07 |
| 2,500 % fällig am 25.06.2029 | | 4.100 | | 4.503 | 0,20 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.08.2021 | $ | 700 | | 640 | 0,03 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 3.381 | | 470 | 0,02 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 232.200 | | 31.593 | 1,43 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025 | € | 5.600 | | 5.801 | 0,26 |
| 3,950 % fällig am 30.06.2022 | £ | 2.900 | | 3.319 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 02.05.2023 | € | 4.000 | € 4.073 | 0,18 |
| **Liberty Living Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 28.11.2024 | £ | 400 | 454 | 0,02 |
| **Liberty Mutual Group, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 04.05.2026 | € | 3.300 | 3.653 | 0,16 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.04.2024 | | 8.900 | 8.986 | 0,41 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 0,375 % fällig am 18.01.2021 | | 2.300 | 2.327 | 0,11 |
| 4,000 % fällig am 29.09.2020 | | 1.100 | 1.160 | 0,05 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 09.11.2023 | | 1.400 | 1.420 | 0,06 |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | £ | 7.600 | 8.534 | 0,39 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | € | 5.400 | 5.590 | 0,25 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | | 7.800 | 8.326 | 0,38 |
| **Marsh & McLennan Cos., Inc.** | | | | |
| 3,519 % fällig am 29.12.2021 | $ | 100 | 88 | 0,00 |
| **Merlin Properties Socimi S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 26.05.2025 | € | 100 | 105 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 02.11.2026 | | 3.100 | 3.263 | 0,15 |
| 2,225 % fällig am 25.04.2023 | | 1.200 | 1.280 | 0,06 |
| **Metropolitan Life Global Funding** | | | | |
| 0,375 % fällig am 09.04.2024 | | 2.600 | 2.632 | 0,12 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 1,000 % fällig am 02.12.2022 | | 7.000 | 7.218 | 0,33 |
| **NE Property BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.05.2023 | | 2.100 | 2.157 | 0,10 |
| **NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank** | | | | |
| 0,250 % fällig am 10.03.2020 | | 900 | 904 | 0,04 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 175.300 | 23.851 | 1,08 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 1.126 | 157 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 435.900 | 59.308 | 2,68 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 48 | 7 | 0,00 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2025 | $ | 6.900 | 6.326 | 0,29 |
| 4,950 % fällig am 01.04.2024 | | 200 | 186 | 0,01 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | |
| 1,876 % fällig am 17.04.2025 | € | 425 | 460 | 0,02 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | $ | 13.000 | 11.444 | 0,52 |
| **RCI Banque S.A.** | | | | |
| 0,340 % fällig am 12.04.2021 | € | 3.400 | 3.414 | 0,15 |
| 0,750 % fällig am 12.01.2022 | | 300 | 304 | 0,01 |
| 1,625 % fällig am 11.04.2025 | | 1.400 | 1.449 | 0,07 |
| 2,000 % fällig am 11.07.2024 | | 7.100 | 7.513 | 0,34 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2036 | DKK | 69 | 10 | 0,00 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.03.2026 | € | 6.900 | 7.076 | 0,32 |
| 2,000 % fällig am 08.03.2023 | | 400 | 413 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 9.600 | 9.979 | 0,45 |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | | 2.200 | 2.338 | 0,11 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | $ | 5.900 | 5.546 | 0,25 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (f)(h) | | 200 | 180 | 0,01 |
| **Sagax AB** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.01.2024 | € | 1.400 | 1.455 | 0,07 |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | | 4.000 | 4.166 | 0,19 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget Norden AB** | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2025 | | 1.500 | 1.527 | 0,07 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 0,468 % fällig am 18.05.2023 | | 8.000 | 7.900 | 0,36 |
| 0,505 % fällig am 27.03.2024 | | 10.000 | 9.832 | 0,44 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 12.04.2021 | | 900 | 975 | 0,04 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 3,352 % fällig am 15.11.2019 | | 300 | 304 | 0,01 |
| **SELP Finance SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 20.12.2026 | | 7.500 | 7.635 | 0,34 |
| **Sparebanken Soer Boligkreditt A/S** | | | | |
| 0,250 % fällig am 22.03.2021 | | 4.150 | 4.198 | 0,19 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 0,375 % fällig am 25.04.2024 | | 8.800 | 8.857 | 0,40 |
| 2,250 % fällig am 15.03.2021 | $ | 4.400 | 3.876 | 0,17 |
| **TP ICAP PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | £ | 2.700 | € 3.091 | 0,14 |
| **UBS AG** | | | | |
| 0,190 % fällig am 10.01.2020 | € | 4.900 | 4.910 | 0,22 |
| 4,750 % fällig am 12.02.2026 (h) | | 1.000 | 1.069 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h) | $ | 6.200 | 5.786 | 0,26 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | | 3.450 | 3.399 | 0,15 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 650 | 610 | 0,03 |
| **UniCredit Bank AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 05.07.2022 (b) | | 25.000 | 21.867 | 0,99 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 3,750 % fällig am 12.04.2022 | | 900 | 800 | 0,04 |
| 6,497 % fällig am 14.01.2022 | | 6.150 | 5.620 | 0,25 |
| 6,572 % fällig am 14.01.2022 | | 28.500 | 26.614 | 1,20 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | £ | 4.217 | 5.298 | 0,24 |
| 7,395 % fällig am 28.03.2024 | | 400 | 505 | 0,02 |
| **VEREIT Operating Partnership LP** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | $ | 100 | 90 | 0,00 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.05.2027 | € | 900 | 941 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 27.10.2022 | | 600 | 645 | 0,03 |
| **VIVAT NV** | | | | |
| 2,375 % fällig am 17.05.2024 | | 7.727 | 8.208 | 0,37 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,102 % fällig am 15.06.2021 | | 6.600 | 6.594 | 0,30 |
| 1,159 % fällig am 01.08.2022 | | 4.000 | 4.072 | 0,18 |
| 1,250 % fällig am 10.06.2024 | | 3.300 | 3.372 | 0,15 |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 500 | 525 | 0,02 |
| 2,500 % fällig am 31.07.2026 | | 600 | 651 | 0,03 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,375 % fällig am 12.04.2021 | | 4.600 | 4.624 | 0,21 |
| 0,489 % fällig am 15.02.2021 | | 1.500 | 1.509 | 0,07 |
| 0,875 % fällig am 12.04.2023 | | 1.200 | 1.216 | 0,05 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2024 | | 2.000 | 2.062 | 0,09 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 0,140 % fällig am 06.07.2021 | | 2.300 | 2.296 | 0,10 |
| 0,500 % fällig am 20.06.2022 | | 2.500 | 2.512 | 0,11 |
| 1,500 % fällig am 19.06.2026 | | 4.200 | 4.249 | 0,19 |
| 2,625 % fällig am 15.01.2024 | | 11.200 | 12.146 | 0,55 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 02.10.2023 | $ | 100 | 93 | 0,00 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 02.06.2025 | € | 11.800 | 12.689 | 0,57 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.04.2027 | | 1.100 | 1.156 | 0,05 |
| 2,250 % fällig am 09.04.2026 | | 5.900 | 6.300 | 0,28 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | |
| 1,250 % fällig am 11.06.2021 | | 300 | 309 | 0,01 |
| | | | 936.099 | 42,25 |

## INDUSTRIEWERTE

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 1.100 | 1.125 | 0,05 |
| 2,875 % fällig am 31.07.2043 | | 7.811 | 8.330 | 0,38 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 2.000 | 2.205 | 0,10 |
| **Ahlstrom-Munksjo Oyj** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.06.2022 | € | 6.380 | 6.480 | 0,29 |
| **Allergan Funding SCS** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.11.2023 | | 100 | 104 | 0,01 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.05.2026 | $ | 5.100 | 4.512 | 0,20 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.02.2027 | € | 1.900 | 2.063 | 0,09 |
| 7,375 % fällig am 01.05.2026 | $ | 6.200 | 5.594 | 0,25 |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | € | 5.812 | 5.972 | 0,27 |
| **Altria Group, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.02.2023 | | 900 | 921 | 0,04 |
| **Avon International Capital PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.08.2022 (b) | $ | 1.200 | 1.064 | 0,05 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 0,189 % fällig am 16.08.2021 | € | 400 | 400 | 0,02 |
| 1,125 % fällig am 16.11.2023 | | 800 | 819 | 0,04 |
| **BEL SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 18.04.2024 | | 5.000 | 5.041 | 0,23 |
| **Bureau Veritas S.A.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 07.09.2023 | € | 1.600 | € 1.626 | 0,07 |
| **Casino Guichard Perrachon S.A.** | | | | |
| 1,865 % fällig am 13.06.2022 | | 600 | 510 | 0,02 |
| 4,561 % fällig am 25.01.2023 | | 5.800 | 5.079 | 0,23 |
| **Catalent Pharma Solutions, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2027 | $ | 100 | 90 | 0,00 |
| **Cirsa Finance International SARL** | | | | |
| 7,875 % fällig am 20.12.2023 | | 3.500 | 3.265 | 0,15 |
| **Cogent Communications Group, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 30.06.2024 | € | 1.300 | 1.307 | 0,06 |
| **Continental Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.07.2022 | $ | 132 | 119 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 10.05.2021 | | 57 | 51 | 0,00 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2020 | | 100 | 88 | 0,00 |
| **Davide Campari-Milano SpA** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.09.2020 | € | 3.473 | 3.582 | 0,16 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | $ | 900 | 815 | 0,04 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 2.000 | 1.894 | 0,09 |
| 6,020 % fällig am 15.06.2026 | | 2.300 | 2.230 | 0,10 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 20.09.2024 | £ | 4.100 | 4.631 | 0,21 |
| **DP World PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.09.2026 | € | 900 | 944 | 0,04 |
| **EI Group PLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | £ | 1.300 | 1.550 | 0,07 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2024 | $ | 100 | 94 | 0,00 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2022 | | 1.800 | 1.681 | 0,08 |
| **Eurofins Scientific SE** | | | | |
| 2,125 % fällig am 25.07.2024 (i) | € | 9.300 | 9.297 | 0,42 |
| 3,375 % fällig am 30.01.2023 (i) | | 2.300 | 2.393 | 0,11 |
| **Experian Finance PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 04.02.2020 | | 800 | 823 | 0,04 |
| **Fairstone Financial, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.07.2024 (b) | $ | 1.000 | 897 | 0,04 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.05.2023 | € | 1.300 | 1.327 | 0,06 |
| 1,500 % fällig am 21.05.2027 | | 500 | 522 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 21.05.2030 | | 700 | 747 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 15.10.2022 | $ | 740 | 690 | 0,03 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 01.07.2023 (b) | € | 1.900 | 1.913 | 0,09 |
| **G4S International Finance PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 09.01.2023 | | 6.100 | 6.220 | 0,28 |
| 1,875 % fällig am 24.05.2025 | | 3.500 | 3.584 | 0,16 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 17.05.2022 | | 600 | 604 | 0,03 |
| 0,875 % fällig am 17.05.2025 | | 900 | 898 | 0,04 |
| 1,250 % fällig am 26.05.2023 | | 1.400 | 1.445 | 0,07 |
| 1,500 % fällig am 17.05.2029 | | 600 | 593 | 0,03 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,735 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c) | | 11.200 | 11.477 | 0,52 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (c) | | 6.100 | 6.197 | 0,28 |
| **IMCD NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.03.2025 | | 6.630 | 6.817 | 0,31 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.08.2023 | | 3.900 | 3.982 | 0,18 |
| 2,125 % fällig am 12.02.2027 | | 3.000 | 3.138 | 0,14 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.11.2025 | | 3.500 | 3.478 | 0,16 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 05.07.2023 | | 2.800 | 2.911 | 0,13 |
| **Ingenico Group S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 13.09.2024 | | 13.400 | 13.366 | 0,60 |
| **InterXion Holding NV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.06.2025 | | 600 | 655 | 0,03 |
| **ITV PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 21.09.2022 | | 1.400 | 1.459 | 0,07 |
| **James Hardie International Finance Co.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2026 | | 1.000 | 1.063 | 0,05 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | £ | 1.300 | € 1.638 | 0,07 |
| **Kemira Oyj** | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.05.2024 | € | 300 | 309 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2022 | | 3.200 | 3.342 | 0,15 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.09.2024 | $ | 100 | 94 | 0,00 |
| 4,300 % fällig am 01.05.2024 | | 100 | 93 | 0,00 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 3,877 % fällig am 15.01.2023 | | 1.000 | 887 | 0,04 |
| **Leonardo SpA** | | | | |
| 8,000 % fällig am 16.12.2019 | £ | 5.700 | 6.565 | 0,30 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.12.2023 | | 400 | 458 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 12.06.2025 | | 3.093 | 3.767 | 0,17 |
| 6,125 % fällig am 02.12.2019 | | 1.300 | 1.481 | 0,07 |
| **Medtronic Global Holdings S.C.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.12.2022 (b)(d) | € | 4.400 | 4.407 | 0,20 |
| **Midcontinent Express Pipeline LLC** | | | | |
| 6,700 % fällig am 15.09.2019 | $ | 4.900 | 4.344 | 0,20 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 1,236 % fällig am 15.12.2030 | £ | 682 | 715 | 0,03 |
| 2,860 % fällig am 15.12.2030 | $ | 1.178 | 966 | 0,04 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | € | 2.700 | 2.932 | 0,13 |
| **Next Group PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 02.10.2026 | £ | 3.000 | 3.708 | 0,17 |
| **NextEra Energy Operating Partners LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.07.2024 | $ | 1.000 | 885 | 0,04 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 4.100 | 3.725 | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 200 | 186 | 0,01 |
| **PerkinElmer, Inc.** | | | | |
| 0,600 % fällig am 09.04.2021 | € | 5.000 | 5.048 | 0,23 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 2,750 % fällig am 21.04.2027 | | 300 | 264 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 21.02.2028 | | 12.500 | 12.256 | 0,55 |
| **Philip Morris International, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 19.03.2025 | | 7.350 | 8.363 | 0,38 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.12.2029 (b) | $ | 300 | 265 | 0,01 |
| **ProSiebenSat.1 Media SE** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2021 | € | 12.854 | 13.327 | 0,60 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | |
| 5,838 % fällig am 30.09.2027 | $ | 250 | 250 | 0,01 |
| **Roadster Finance DAC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.12.2024 | € | 200 | 200 | 0,01 |
| 2,375 % fällig am 08.12.2027 | | 400 | 403 | 0,02 |
| **Ryanair DAC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 17.06.2021 | | 2.600 | 2.694 | 0,12 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | $ | 1.200 | 1.181 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 1.000 | 977 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 30.06.2026 | | 4.200 | 4.218 | 0,19 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 1.700 | 1.604 | 0,07 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 10.000 | 10.368 | 0,47 |
| **Smurfit Kappa Acquisitions ULC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.01.2026 | | 8.900 | 9.708 | 0,44 |
| **Societa Esercizi Aereoportuali SpA Sea** | | | | |
| 3,125 % fällig am 17.04.2021 | | 1.900 | 1.978 | 0,09 |
| **Stryker Corp.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 30.11.2023 | | 2.200 | 2.302 | 0,10 |
| 2,625 % fällig am 30.11.2030 | | 6.500 | 7.592 | 0,34 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | $ | 1.000 | 913 | 0,04 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 8.225 | 7.544 | 0,34 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | |
| 0,237 % fällig am 21.11.2020 | € | 6.100 | 6.125 | 0,28 |
| 0,787 % fällig am 21.11.2022 | | 5.700 | 5.814 | 0,26 |
| 2,250 % fällig am 21.11.2026 | | 3.400 | 3.769 | 0,17 |
| 3,000 % fällig am 21.11.2030 | | 1.700 | 1.968 | 0,09 |
| **Tauron Polska Energia S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 05.07.2027 | | 6.900 | 7.094 | 0,32 |
| **TDF Infrastructure S.A.S.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 07.04.2026 | € | 2.200 | € 2.332 | 0,11 |
| 2,875 % fällig am 19.10.2022 | | 8.400 | 8.942 | 0,40 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.10.2023 | | 2.400 | 2.486 | 0,11 |
| **Tesco PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | £ | 256 | 320 | 0,01 |
| **Teva Pharmaceutical Finance BV** | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | $ | 900 | 766 | 0,03 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Co. BV** | | | | |
| 2,950 % fällig am 18.12.2022 | | 300 | 241 | 0,01 |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | | 400 | 339 | 0,02 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 15.10.2024 | € | 3.500 | 2.907 | 0,13 |
| 1,250 % fällig am 31.03.2023 | | 3.600 | 3.217 | 0,15 |
| 2,800 % fällig am 21.07.2023 | $ | 1.700 | 1.295 | 0,06 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2021 | £ | 200 | 232 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 07.09.2023 | | 5.600 | 6.461 | 0,29 |
| **U.S. Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,625 % fällig am 03.12.2026 | $ | 871 | 828 | 0,04 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | |
| 1,289 % fällig am 30.01.2023 | € | 6.900 | 7.013 | 0,32 |
| **UCB S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 02.10.2023 | | 856 | 1.011 | 0,05 |
| **United Technologies Corp.** | | | | |
| 1,150 % fällig am 18.05.2024 | | 400 | 417 | 0,02 |
| **UPCB Finance Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.01.2027 | | 6.390 | 6.748 | 0,30 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | £ | 1.300 | 1.500 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | | 200 | 231 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 15.05.2029 | | 500 | 580 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 15.05.2029 | $ | 2.000 | 1.786 | 0,08 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | | 400 | 354 | 0,02 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.11.2021 | | 3.000 | 2.720 | 0,12 |
| **Wind Tre SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 20.01.2023 | € | 15.200 | 15.344 | 0,69 |
| 2,750 % fällig am 20.01.2024 | | 2.200 | 2.175 | 0,10 |
| 3,125 % fällig am 20.01.2025 | | 3.200 | 3.199 | 0,14 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.04.2025 | $ | 1.089 | 989 | 0,04 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,425 % fällig am 13.12.2026 | € | 3.800 | 4.145 | 0,19 |
| | | | 395.987 | 17,87 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 2,350 % fällig am 05.09.2029 | | 2.800 | 3.120 | 0,14 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 26.09.2023 | | 1.500 | 1.540 | 0,07 |
| 1,000 % fällig am 23.06.2024 | | 800 | 825 | 0,04 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | $ | 1.100 | 1.051 | 0,05 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | € | 700 | 751 | 0,03 |
| **Global Switch Holdings Ltd.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 31.01.2024 | | 1.500 | 1.548 | 0,07 |
| 2,250 % fällig am 31.05.2027 | | 500 | 535 | 0,02 |
| **IE2 Holdco S.A.U.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.06.2026 | | 400 | 449 | 0,02 |
| **innogy Finance BV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 20.04.2021 | £ | 2.200 | 2.681 | 0,12 |
| **Novatek OAO via Novatek Finance DAC** | | | | |
| 6,604 % fällig am 03.02.2021 | $ | 200 | 185 | 0,01 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.10.2029 | £ | 4.900 | 5.713 | 0,26 |
| **Redexis Gas Finance BV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 27.04.2027 | € | 4.800 | 4.840 | 0,22 |
| **SPP-Distribucia A/S** | | | | |
| 2,625 % fällig am 23.06.2021 | | 3.700 | 3.884 | 0,18 |
| **Talen Energy Supply LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 (b) | $ | 200 | 175 | 0,01 |
| **Telenor ASA** | | | | |
| 0,750 % fällig am 31.05.2026 | € | 1.300 | € 1.340 | 0,06 |
| **Transmission Finance DAC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.05.2023 | | 700 | 736 | 0,03 |
| | | | 29.373 | 1,33 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 1.361.459 | 61,45 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | $ | 366.500 | 328.991 | 14,85 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2023 | | 76.700 | 70.029 | 3,16 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 4,734 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 66 | 54 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 3,424 % fällig am 25.11.2046 | | 554 | 246 | 0,01 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.06.2037 | | 413 | 283 | 0,01 |
| 4,236 % fällig am 25.06.2037 ^(a) | | 456 | 71 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2033 | | 479 | 443 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 210 | 188 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 450 | 387 | 0,02 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 2,573 % fällig am 20.10.2036 | | 141 | 111 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 118 | 88 | 0,00 |
| 4,523 % fällig am 20.09.2046 ^ | | 101 | 81 | 0,00 |
| 4,731 % fällig am 20.04.2035 ^ | | 138 | 113 | 0,01 |
| 4,777 % fällig am 20.09.2046 ^ | | 99 | 85 | 0,00 |
| 4,870 % fällig am 20.11.2035 ^ | | 168 | 143 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 705 | 586 | 0,03 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 20 | 17 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 4,121 % fällig am 27.03.2037 | | 369 | 279 | 0,01 |
| 4,170 % fällig am 26.03.2037 | | 122 | 95 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2034 ^ | | 34 | 29 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 4,275 % fällig am 25.08.2035 | | 47 | 37 | 0,00 |
| 4,563 % fällig am 25.02.2035 | | 21 | 18 | 0,00 |
| 4,792 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 472 | 385 | 0,02 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 3,999 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 105 | 84 | 0,00 |
| 4,153 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 280 | 170 | 0,01 |
| 4,388 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 536 | 340 | 0,02 |
| 4,528 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 549 | 398 | 0,02 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.11.2034 ^ | | 308 | 273 | 0,01 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 7,500 % fällig am 25.08.2036 | | 33 | 28 | 0,00 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 3,974 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 476 | 387 | 0,02 |
| 4,162 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 52 | 45 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 135 | 90 | 0,00 |
| **ChaseFlex Trust** | | | | |
| 4,215 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 42 | 37 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 112 | 80 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,170 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 84 | 68 | 0,00 |
| 4,417 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 20 | 15 | 0,00 |
| 4,539 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 293 | 229 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 | | 198 | 143 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2037 | | 189 | 122 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,734 % fällig am 25.12.2034 | | 15 | 13 | 0,00 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 2 | 2 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 433 | 376 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 742 | 651 | 0,03 |
| **Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 160 | 104 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 3,506 % fällig am 25.05.2036 | $ 30 | € 22 | 0,00 |
| 3,988 % fällig am 25.06.2037 ^ | 163 | 136 | 0,01 |
| 4,385 % fällig am 25.09.2034 | 7 | 6 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | 114 | 79 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | 113 | 83 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2036 ^ | 80 | 62 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2047 ^ | 146 | 112 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | 196 | 134 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | 220 | 154 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | 51 | 40 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | 267 | 209 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | 94 | 69 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 1.022 | 638 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | 457 | 328 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 25.07.2036 ^ | 1.990 | 1.322 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036 ^ | 28 | 18 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2036 ^ | 79 | 49 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2037 ^ | 410 | 262 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 2,644 % fällig am 25.04.2036 ^ | 263 | 189 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 3,004 % fällig am 25.03.2035 | 401 | 316 | 0,02 |
| 3,024 % fällig am 25.03.2035 | 31 | 26 | 0,00 |
| 3,144 % fällig am 25.02.2035 | 341 | 286 | 0,01 |
| 3,526 % fällig am 20.02.2036 | 273 | 205 | 0,01 |
| 3,972 % fällig am 20.12.2035 ^ | 130 | 113 | 0,01 |
| 4,025 % fällig am 25.09.2047 ^ | 153 | 128 | 0,01 |
| 4,040 % fällig am 25.11.2037 | 237 | 187 | 0,01 |
| 4,075 % fällig am 25.01.2036 ^ | 97 | 80 | 0,00 |
| 4,297 % fällig am 20.09.2036 ^ | 41 | 31 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 ^ | 121 | 92 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | 176 | 131 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | 26 | 18 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | 227 | 149 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | 450 | 278 | 0,01 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 3,554 % fällig am 25.09.2034 ^ | 70 | 63 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | 243 | 196 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 4,230 % fällig am 28.08.2036 | 11 | 10 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 2,704 % fällig am 25.08.2036 ^ | 2.025 | 1.099 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | 105 | 77 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2021 ^ | 240 | 130 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.02.2022 ^ | 515 | 122 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc.** | | | |
| 2,704 % fällig am 25.04.2037 | 351 | 198 | 0,01 |
| **EuroMASTR PLC** | | | |
| 0,986 % fällig am 15.06.2040 | £ 182 | 196 | 0,01 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | |
| 4,022 % fällig am 25.01.2036 ^ | $ 298 | 203 | 0,01 |
| 4,273 % fällig am 25.04.2036 ^ | 150 | 125 | 0,01 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 4,422 % fällig am 25.11.2037 ^ | 64 | 55 | 0,00 |
| **GSC Capital Corp. Mortgage Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.05.2036 ^ | 135 | 112 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 | 260 | 243 | 0,01 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,393 % fällig am 19.06.2036 ^ | 134 | 81 | 0,00 |
| 3,990 % fällig am 19.12.2035 ^ | 140 | 93 | 0,00 |
| 4,908 % fällig am 19.12.2035 ^ | 65 | 57 | 0,00 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 298 | 240 | 0,01 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.11.2036 | 619 | 514 | 0,02 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | 93 | 80 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,124 % fällig am 25.01.2035 | 78 | 59 | 0,00 |
| 3,736 % fällig am 25.06.2036 | 71 | 61 | 0,00 |
| 3,835 % fällig am 25.06.2037 ^ | 1.652 | 1.240 | 0,06 |
| 3,910 % fällig am 25.11.2035 ^ | 143 | 119 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2037 ^ | 57 | 37 | 0,00 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,930 % fällig am 27.06.2037 | 406 | 312 | 0,01 |
| 3,906 % fällig am 25.12.2036 | 18 | 16 | 0,00 |
| 6,050 % fällig am 25.05.2036 | 32 | 27 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2036 ^ | 277 | 206 | 0,01 |
| **Lavender Trust** | | | |
| 6,250 % fällig am 26.10.2036 | $ 232 | € 162 | 0,01 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | |
| 5,192 % fällig am 25.01.2036 ^ | 153 | 136 | 0,01 |
| 5,320 % fällig am 25.12.2035 | 227 | 109 | 0,01 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | |
| 1,436 % fällig am 15.12.2049 | £ 87 | 95 | 0,01 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | |
| 4,087 % fällig am 25.03.2035 | $ 27 | 23 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 192 | 165 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 4,347 % fällig am 25.03.2036 ^ | 442 | 282 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,184 % fällig am 25.03.2036 ^ | 222 | 171 | 0,01 |
| 5,962 % fällig am 25.06.2036 ^ | 5.345 | 1.991 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 ^ | 82 | 59 | 0,00 |
| **Newgate Funding PLC** | | | |
| 0,282 % fällig am 15.12.2050 | € 319 | 309 | 0,01 |
| 1,786 % fällig am 15.12.2050 | £ 253 | 273 | 0,01 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 2,614 % fällig am 25.06.2037 | $ 105 | 82 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | 117 | 96 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 94 | 77 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.02.2037 ^ | 242 | 200 | 0,01 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | 391 | 252 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 | 173 | 106 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | 138 | 77 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | 116 | 61 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 957 | 730 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | 94 | 55 | 0,00 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | 86 | 72 | 0,00 |
| **RMAC Securities PLC** | | | |
| 0,963 % fällig am 12.06.2044 | £ 657 | 697 | 0,03 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,033 % fällig am 25.06.2036 ^ | $ 10 | 9 | 0,00 |
| 4,195 % fällig am 25.02.2036 ^ | 100 | 82 | 0,00 |
| 4,284 % fällig am 25.10.2035 ^ | 341 | 285 | 0,01 |
| **SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,757 % fällig am 25.02.2037 ^ | 298 | 254 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ 6.800 | 7.628 | 0,35 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 3,700 % fällig am 25.12.2036 ^ | $ 500 | 423 | 0,02 |
| 3,848 % fällig am 25.10.2036 ^ | 61 | 49 | 0,00 |
| 3,981 % fällig am 25.05.2037 ^ | 107 | 92 | 0,00 |
| 4,062 % fällig am 25.12.2035 | 21 | 18 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 3,274 % fällig am 25.04.2047 | 641 | 430 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 ^ | 152 | 111 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 55 | 50 | 0,00 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,250 % fällig am 25.11.2037 ^ | 76 | 66 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 5,221 % fällig am 25.03.2036 ^ | 70 | 62 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2036 ^ | 71 | 62 | 0,00 |
| | | 35.218 | 1,59 |

**FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE**

| | | | |
|---|---|---|---|
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,514 % fällig am 25.12.2036 | 274 | 88 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.07.2036 | 170 | 120 | 0,01 |
| **Adagio CLO Ltd.** | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2029 | € 600 | 602 | 0,03 |
| **Apex Credit CLO Ltd.** | | | |
| 3,632 % fällig am 27.10.2028 | $ 1.100 | 967 | 0,04 |
| **Arbour CLO DAC** | | | |
| 0,580 % fällig am 15.03.2029 | € 2.100 | 2.094 | 0,09 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | 5.500 | 5.499 | 0,25 |
| **Argent Securities Trust** | | | |
| 2,504 % fällig am 25.06.2036 | $ 535 | 165 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | 992 | 357 | 0,02 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,724 % fällig am 25.01.2036 | $ 683 | € 563 | 0,03 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | |
| 3,404 % fällig am 25.06.2037 | 110 | 84 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.03.2034 ^ | 241 | 199 | 0,01 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 4,172 % fällig am 15.08.2033 | 23 | 21 | 0,00 |
| **Aurium CLO DAC** | | | |
| 0,680 % fällig am 13.10.2029 | € 3.500 | 3.491 | 0,16 |
| 0,800 % fällig am 26.04.2029 | 900 | 901 | 0,04 |
| **Babson Euro CLO BV** | | | |
| 0,509 % fällig am 25.10.2029 | 5.000 | 4.981 | 0,23 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 3,566 % fällig am 25.10.2036 | $ 49 | 30 | 0,00 |
| **Black Diamond CLO Designated Activity Co.** | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € 1.900 | 1.902 | 0,09 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | |
| 0,850 % fällig am 15.04.2027 | 2.427 | 2.426 | 0,11 |
| **Cairn CLO BV** | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | 800 | 802 | 0,04 |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | 7.100 | 7.108 | 0,32 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | |
| 0,730 % fällig am 21.09.2029 | 2.400 | 2.401 | 0,11 |
| 0,870 % fällig am 18.01.2030 | 3.600 | 3.600 | 0,16 |
| **Castle Park CLO Designated Activity Co.** | | | |
| 0,690 % fällig am 15.01.2028 | 1.500 | 1.504 | 0,07 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 6,351 % fällig am 25.05.2036 ^ | $ 167 | 84 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.06.2047 | 78 | 69 | 0,00 |
| **CVC Cordatus Loan Fund Ltd.** | | | |
| 0,970 % fällig am 22.04.2030 | € 8.700 | 8.737 | 0,39 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | 800 | 801 | 0,04 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | |
| 0,718 % fällig am 17.05.2027 | 848 | 849 | 0,04 |
| 0,720 % fällig am 15.07.2030 | 4.700 | 4.679 | 0,21 |
| 0,880 % fällig am 15.01.2030 | 3.800 | 3.804 | 0,17 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | 5.600 | 5.601 | 0,25 |
| **First NLC Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.08.2037 | $ 187 | 106 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.08.2037 | 62 | 36 | 0,00 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | 267 | 138 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.02.2037 | 847 | 383 | 0,02 |
| 2,590 % fällig am 25.08.2036 | 222 | 86 | 0,00 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | € 2.300 | 2.302 | 0,10 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | |
| 5,772 % fällig am 25.11.2036 ^ | $ 167 | 78 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 2,504 % fällig am 25.12.2046 | 252 | 139 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | 432 | 183 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.12.2046 | 692 | 384 | 0,02 |
| 2,604 % fällig am 25.11.2036 | 253 | 136 | 0,01 |
| 2,634 % fällig am 25.12.2046 | 126 | 71 | 0,00 |
| **Harvest CLO DAC** | | | |
| 0,609 % fällig am 15.11.2028 | € 1.307 | 1.306 | 0,06 |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | 1.000 | 1.000 | 0,05 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | |
| 2,514 % fällig am 25.12.2036 | $ 234 | 83 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 | 1.124 | 400 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.12.2036 | 651 | 234 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 4,909 % fällig am 25.11.2036 | 613 | 552 | 0,03 |
| 6,337 % fällig am 25.08.2036 ^ | 124 | 81 | 0,00 |
| **Jubilee CLO BV** | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | € 2.700 | 2.693 | 0,12 |
| 0,530 % fällig am 12.07.2028 | 2.800 | 2.800 | 0,13 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | $ 86 | 73 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.02.2037 ^ | 1.791 | 1.311 | 0,06 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,454 % fällig am 25.11.2036 | 169 | 70 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.08.2036 | $ 298 | € 138 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.06.2036 | 176 | 90 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2036 | 179 | 85 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.11.2037 | 766 | 360 | 0,02 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,504 % fällig am 25.09.2036 | 67 | 29 | 0,00 |
| 2,514 % fällig am 25.02.2037 | 565 | 234 | 0,01 |
| 2,534 % fällig am 25.01.2037 | 128 | 64 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.10.2036 | 142 | 77 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | 396 | 173 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.03.2037 | 416 | 200 | 0,01 |
| 2,604 % fällig am 25.02.2037 | 143 | 77 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.03.2037 | 416 | 202 | 0,01 |
| 3,454 % fällig am 25.06.2033 | 22 | 20 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.04.2037 | 355 | 211 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 5,965 % fällig am 25.09.2046 ^ | 379 | 190 | 0,01 |
| **Newhaven CLO DAC** | | | |
| 0,990 % fällig am 15.02.2030 | € 400 | 401 | 0,02 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 6,032 % fällig am 25.10.2036 ^ | $ 176 | 61 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | 193 | 94 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.06.2036 | 130 | 97 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.01.2037 | 353 | 208 | 0,01 |
| 2,734 % fällig am 25.04.2037 | 129 | 76 | 0,00 |
| **Orwell Park CLO Designated Activity Co.** | | | |
| 0,780 % fällig am 18.07.2029 | € 1.100 | 1.101 | 0,05 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | |
| 4,290 % fällig am 25.09.2037 | $ 235 | 171 | 0,01 |
| 5,879 % fällig am 25.06.2037 ^ | 3.494 | 1.374 | 0,06 |
| 7,238 % fällig am 25.09.2037 ^ | 249 | 127 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Income Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 2,494 % fällig am 25.07.2036 | 244 | 110 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.07.2036 | 239 | 109 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.07.2036 | 204 | 95 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.05.2036 | 886 | 509 | 0,02 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 2,514 % fällig am 25.02.2037 | 305 | 102 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.02.2037 | 450 | 153 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.06.2037 | $ 203 | € 128 | 0,01 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2037 | 131 | 71 | 0,00 |
| **St Paul's CLO DAC** | | | |
| 0,850 % fällig am 20.08.2030 | € 7.300 | 7.306 | 0,33 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | $ 120 | 102 | 0,00 |
| **Tikehau CLO BV** | | | |
| 0,600 % fällig am 04.08.2028 | € 600 | 599 | 0,03 |
| 0,880 % fällig am 07.12.2029 (b) | 5.300 | 5.300 | 0,24 |
| 1,060 % fällig am 07.12.2029 | 1.000 | 1.001 | 0,05 |
| **Toro European CLO DAC** | | | |
| 0,900 % fällig am 15.10.2030 | 7.300 | 7.318 | 0,33 |
| | | 107.937 | 4,87 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Agence Francaise de Developpement** | | | |
| 2,750 % fällig am 22.03.2021 | $ 7.800 | 6.938 | 0,31 |
| **Argentina Government International Bond** | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | € 2.800 | 2.193 | 0,10 |
| 3,380 % fällig am 31.12.2038 | 3.500 | 2.001 | 0,09 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | 5.800 | 6.276 | 0,28 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | 11.100 | 11.417 | 0,52 |
| **Egypt Government International Bond** | | | |
| 4,750 % fällig am 11.04.2025 | 6.900 | 7.065 | 0,32 |
| **Fondo De Titulizacion Del Deficit Del Sistema Electrico FTA** | | | |
| 0,500 % fällig am 17.03.2023 | 6.700 | 6.861 | 0,31 |
| **Indonesia Government International Bond** | | | |
| 1,750 % fällig am 24.04.2025 | 5.000 | 5.204 | 0,24 |
| 3,375 % fällig am 30.07.2025 | 15.400 | 17.457 | 0,79 |
| **Oman Government International Bond** | | | |
| 6,750 % fällig am 17.01.2048 | $ 1.800 | 1.399 | 0,06 |
| **Qatar Government International Bond** | | | |
| 3,375 % fällig am 14.03.2024 | 2.000 | 1.817 | 0,08 |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | 5.000 | 4.610 | 0,21 |
| **Romania Government International Bond** | | | |
| 2,000 % fällig am 08.12.2026 | € 10.900 | 11.562 | 0,52 |
| **Russia Government International Bond** | | | |
| 2,875 % fällig am 04.12.2025 | 10.000 | 10.721 | 0,48 |
| **Saudi Government International Bond** | | | |
| 2,375 % fällig am 26.10.2021 | $ 1.000 | € 878 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | 7.800 | 7.301 | 0,33 |
| **Turkey Government International Bond** | | | |
| 4,625 % fällig am 31.03.2025 | € 6.400 | 6.394 | 0,29 |
| **Ukraine Government International Bond** | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2020 | $ 26.100 | 23.702 | 1,07 |
| | | 133.796 | 6,04 |
| **AKTIEN** | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (g)** | 2.132.180 | 213.687 | 9,65 |
| | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (j)** | | 141.257 | 6,38 |
| **GREECE TREASURY BILLS** | | | |
| 0,556 % fällig am 04.10.2019 (d)(e) | € 2.500 | 2.498 | 0,11 |
| 0,587 % fällig am 04.10.2019 (d)(e) | 9.200 | 9.193 | 0,41 |
| 0,618 % fällig am 30.08.2019 (d)(e) | 2.600 | 2.599 | 0,12 |
| 0,729 % fällig am 30.08.2019 (d)(e) | 4.600 | 4.598 | 0,21 |
| 0,414 % fällig am 06.12.2019 (d)(e) | 2.400 | 2.397 | 0,11 |
| | | 21.285 | 0,96 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 162.542 | 7,34 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **€ 2.524.005** | **113,93** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09/2019 | 193 | € 102 | 0,01 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09/2019 | 533 | 52 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 523 | 1.099 | 0,05 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 125 | (154) | (0,01) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1.427 | 1.914 | 0,09 |
| | | | | € 3.013 | 0,14 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 126,500 | 26.07.2019 | 315 | € (71) | € (39) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 315 | (63) | (73) | (0,01) |
| | | | | € (134) | € (112) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **€ 2.901** | **0,13** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 22.700 | € 105 | 0,01 |
| BAT International Finance PLC | 1,000 | 20.12.2023 | € 8.300 | 61 | 0,00 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 1,000 | 20.12.2020 | 7.300 | (386) | (0,02) |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 1,000 | 20.12.2021 | 3.500 | (365) | (0,02) |
| Daimler AG | 1,000 | 20.12.2020 | 200 | 0 | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.06.2023 | $ 5.100 | (70) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 3.600 | 147 | 0,01 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 1.300 | 6 | 0,00 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 3.300 | 34 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2024 | 7.100 | 64 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2024 | 5.500 | (27) | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A.U. | 1,000 | 20.12.2023 | 16.700 | 374 | 0,02 |
| Telefonica Emisiones S.A.U. | 1,000 | 20.06.2024 | 5.600 | 31 | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.12.2023 | 7.500 | 103 | 0,01 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2024 | 4.900 | 32 | 0,00 |
| Volkswagen International Finance NV | 1,000 | 20.06.2024 | 4.000 | 12 | 0,00 |
| | | | | € 121 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 10.100 | € 109 | 0,00 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 54.100 | 494 | 0,02 |
| iTraxx Crossover 31 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2024 | € 41.900 | 145 | 0,01 |
| | | | | € 748 | 0,03 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 18.12.2021 | $ 160.000 | € (319) | (0,01) |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 18.12.2029 | 7.600 | 47 | 0,00 |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 18.12.2029 | 7.200 | 44 | 0,00 |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 18.12.2049 | 43.200 | (332) | (0,02) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | € 9.400 | (877) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,500 | 19.06.2049 | 61.300 | (8.302) | (0,37) |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | £ 25.000 | (523) | (0,02) |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 5.800 | (437) | (0,02) |
| | | | | | € (10.699) | (0,48) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (9.830)** | **(0,44)** |

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

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

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

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 % | 21.08.2019 | 4.500 | € (5) | € (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 6.100 | (5) | (1) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 7.900 | (11) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 6.900 | (10) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 1.600 | (2) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 6.200 | (6) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 4.900 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 18.09.2019 | 11.000 | (18) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 17.700 | (31) | (5) | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 % | 18.09.2019 | 13.900 | € (22) | € (4) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 23.500 | (38) | (7) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 6.200 | (9) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 4.500 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 5.300 | (7) | (1) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 900 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 4.600 | (7) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,900 | 17.06.2020 | 33.300 | (27) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 9.700 | (9) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 8.200 | (9) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 6.900 | (12) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 20.600 | (29) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 3,000 | 17.06.2020 | 33.300 | (30) | (7) | 0,00 |
| JLN | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 18.09.2019 | 11.100 | (20) | (4) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 3.600 | (5) | (1) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 4.300 | (4) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | € (326) | € (59) | (0,01) |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,650 % | 12.07.2019 | 48.500 | € (78) | € (55) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,000 | 12.07.2019 | 48.500 | (78) | (8) | 0,00 |
| FBF | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,130 | 05.07.2019 | 24.300 | (56) | (315) | (0,02) |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,640 | 19.07.2019 | 48.900 | (92) | (73) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,000 | 19.07.2019 | 48.900 | (79) | (17) | 0,00 |
| | | | | | | | € (383) | € (468) | (0,02) |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Hammerson PLC | 1,000 % | 20.06.2021 | € 900 | € (25) | € 37 | € 12 | 0,00 |
| BPS | Hammerson PLC | 1,000 | 20.06.2021 | 900 | (26) | 37 | 11 | 0,00 |
| CBK | Heathrow Funding Ltd. | 1,000 | 20.06.2021 | 200 | 1 | 2 | 3 | 0,00 |
| GST | Hammerson PLC | 1,000 | 20.06.2021 | 1.200 | (35) | 50 | 15 | 0,00 |
| | Hammerson PLC | 1,000 | 20.12.2022 | 3.600 | 31 | (2) | 29 | 0,00 |
| | Heathrow Funding Ltd. | 1,000 | 20.06.2021 | 200 | 1 | 2 | 3 | 0,00 |
| JPM | Heathrow Funding Ltd. | 1,000 | 20.06.2021 | 100 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| UAG | Avolon Holdings Ltd. | 5,000 | 01.07.2020 | $ 2.200 | 110 | (30) | 80 | 0,01 |
| | | | | | € 57 | € 97 | € 154 | 0,01 |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 24.076 | € | 21.285 | € 144 | € 0 | € 144 | 0,01 |
| | 08/2019 | € | 9.318 | £ | 8.332 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 3.007 | BRL | 11.631 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 15.650 | $ | 11.433 | 0 | (128) | (128) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 5.284 | KRW | 6.109.983 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 5.698 | TWD | 175.558 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | DKK | 206.915 | € | 27.708 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 21.955 | $ | 24.976 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 18.180 | € | 16.083 | 118 | 0 | 118 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 121 | TRY | 715 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | ARS | 5.488 | $ | 123 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 2.011 | € | 1.245 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 10.025 | | 11.507 | 319 | 0 | 319 | 0,01 |
| | 08/2019 | $ | 173 | MXN | 3.453 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 99 | RUB | 6.438 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 13.489.195 | $ | 11.378 | 0 | (262) | (262) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 11.245 | CNH | 77.352 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 5.702 | TWD | 175.541 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 3.453 | $ | 171 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| BRC | 09/2019 | $ | 3.106 | IDR | 44.331.938 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | ARS 231.495 | $ 4.749 | € 0 | € (426) | € (426) | (0,02) |
| | 07/2019 | € 429.489 | 488.114 | 0 | (868) | (868) | (0,04) |
| | 08/2019 | 4.099 | £ 3.618 | 0 | (61) | (61) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 489.359 | € 429.489 | 870 | 0 | 870 | 0,04 |
| GLM | 07/2019 | € 9.467 | $ 10.608 | 0 | (152) | (152) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 19.974 | € 17.526 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07/2019 | 12.187 | RUB 798.029 | 388 | (1) | 387 | 0,02 |
| | 08/2019 | € 1.716 | £ 1.541 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | RUB 581.816 | $ 8.837 | 0 | (269) | (269) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ 6.491 | BRL 25.130 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| | 09/2019 | 6.396 | IDR 91.366.860 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 10/2019 | 4.422 | MXN 86.397 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 4.665 | ARS 231.495 | 499 | 0 | 499 | 0,02 |
| | 08/2019 | 3.032 | BRL 11.741 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 09/2019 | 11.535 | SGD 15.640 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD 206.050 | $ 6.582 | 0 | (98) | (98) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | DKK 53.875 | € 7.221 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | € 2.905 | $ 3.280 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD 31.683 | € 19.465 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ 699 | 803 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK 1.225 | 113 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ 3.028 | IDR 43.248.924 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | 312 | KRW 360.323 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD 66.203 | $ 2.110 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | $ 8.901 | RUB 562.276 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | DKK 572.065 | € 76.678 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| RBC | 09/2019 | $ 5.937 | KRW 6.857.267 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| RYL | 10/2019 | MXN 82.944 | $ 4.233 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | DKK 6.353 | € 851 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ 105.461 | 121.805 | 4.117 | 0 | 4.117 | 0,18 |
| | 11/2019 | TWD 82.605 | $ 2.639 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | $ 1.000 | € 895 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 08/2019 | € 4.086 | £ 3.591 | 0 | (78) | (78) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ 466.634 | € 417.305 | 7.545 | 0 | 7.545 | 0,34 |
| UAG | 07/2019 | € 111.987 | DKK 836.027 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH 77.901 | $ 11.231 | 0 | (87) | (87) | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK 836.027 | € 112.048 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | | | | € 14.256 | € (2.690) | € 11.566 | 0,52 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€ 11.193** | **0,50** |
| **Summe Anlagen** | **€ 2.528.269** | **114,12** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **€ (312.782)** | **(14,12)** |
| **Nettovermögen** | **€ 2.215.487** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(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) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 16.104 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von EUR 448 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von EUR 43.608 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von EUR 1.813 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 16.578 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | € (14.849) | € 14.560 | € 14.560 | 0,66 |
| RYL | (0,500) | 28.06.2019 | 01.07.2019 | € 19.500 | Republic of Germany 6,500 % fällig am 07.04.2027 | (19.588) | 19.500 | 19.499 | 0,88 |
| | (0,460) | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 107.200 | European Investment Bank 0,100 % - 0,200 % fällig am 15.07.2024 - 15.10.2026 | (66.247) | 107.200 | 107.196 | 4,84 |
| | | | | | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,125 % fällig am 11.07.2023 | (41.094) | | | |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (141.778)** | **€ 141.257** | **€ 141.255** | **6,38** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 213.687 | € 2.305.938 | € 4.380 | € 2.524.005 |
| Finanzderivate[3] | 2.901 | 1.283 | 80 | 4.264 |
| **Summen** | **€ 216.588** | **€ 2.307.221** | **€ 4.460** | **€ 2.528.269** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 14.789 | € 1.507.444 | € 10.816 | € 1.533.049 |
| Finanzderivate[3] | 2.972 | (5.831) | 97 | (2.762) |
| **Summen** | **€ 17.761** | **€ 1.501.613** | **€ 10.913** | **€ 1.530.287** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (1,500) % | 18.06.2019 | TBD[1] | € (102) | € (102) | (0,01) |
| CFR | (3,450) | 25.03.2019 | TBD[1] | (1.994) | (1.975) | (0,09) |
| | (3,000) | 13.02.2019 | TBD[1] | (2.425) | (2.397) | (0,11) |
| | (3,000) | 15.02.2019 | TBD[1] | (2.028) | (2.005) | (0,09) |
| | (1,250) | 18.04.2019 | TBD[1] | (9.400) | (9.376) | (0,42) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **€ (15.855)** | **(0,72)** |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (43) | € 123 | € 80 |
| BPS | 151 | 900 | 1051 |
| BRC | (13) | 0 | (13) |
| CBK | (482) | 228 | (254) |
| CKL | (8) | 0 | (8) |
| DUB | (2) | (18) | (20) |
| FBF | (315) | 263 | (52) |
| GLM | (88) | 299 | 211 |
| GST | 24 | 0 | 24 |
| HUS | 454 | (228) | 226 |
| JLN | (4) | 0 | (4) |
| JPM | (52) | 0 | (52) |
| MSB | (3) | 0 | (3) |
| MYC | (1) | 0 | (1) |
| MYI | 32 | 0 | 32 |
| RBC | (1) | 0 | (1) |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| RYL | € (9) | € (70) | € (79) |
| SCX | 4.079 | (4.417) | (338) |
| SSB | (61) | 0 | (61) |
| TOR | 7.545 | (7.122) | 423 |
| UAG | (10) | 0 | (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.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 94,77 | 82,68 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 12,12 | 19,56 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 7,04 | 0,79 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,13 | 0,20 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,44) | (0,64) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,50 | 0,26 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,72) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 4,98 | 7,20 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 61,45 | 68,94 |
| US-Regierungsbehörden | 14,85 | 6,62 |
| US-Schatzobligationen | 3,16 | 4,56 |
| Non-Agency-MBS | 1,59 | 1,94 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 4,87 | 5,26 |
| Staatsemissionen | 6,04 | 3,76 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 9,65 | 0,99 |
| Kurzfristige Instrumente | 7,34 | 3,76 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,14 | 0,20 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | 0,00 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,01 | (0,12) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,03 | (0,08) |
| Zinsswaps | (0,48) | (0,44) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | (0,02) |
| Zinsswapoption | (0,02) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,01 | (0,01) |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,00 | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | 0,52 | 0,29 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,00 | (0,01) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (14,12) | (2,85) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Long Average Duration Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | $ | 100 | € | 88 | 0,03 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 300 | | 323 | 0,11 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.09.2023 (f)(h) | | 200 | | 204 | 0,07 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (f)(h) | | 200 | | 211 | 0,07 |
| **Bank of Ireland** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (f)(h) | | 500 | | 529 | 0,18 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | | |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | | 200 | | 212 | 0,07 |
| **BNG Bank NV** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 29.03.2038 | | 3.000 | | 3.462 | 1,19 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.07.2026 | | 200 | | 210 | 0,07 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 26.04.2038 (i) | | 1.500 | | 1.730 | 0,59 |
| 4,625 % fällig am 29.12.2025 (f)(h) | | 200 | | 215 | 0,07 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h) | $ | 200 | | 188 | 0,07 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 900 | | 908 | 0,31 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | $ | 1.100 | | 980 | 0,34 |
| **Deutsche Hypothekenbank AG** | | | | | |
| 1,043 % fällig am 22.03.2021 | £ | 800 | | 894 | 0,31 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.05.2024 (c) | € | 900 | | 909 | 0,31 |
| 0,250 % fällig am 02.06.2022 | | 600 | | 611 | 0,21 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 24.05.2033 | | 2.100 | | 2.354 | 0,81 |
| **FCE Bank PLC** | | | | | |
| 0,869 % fällig am 13.09.2021 | | 300 | | 301 | 0,10 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | | |
| 2,343 % fällig am 02.11.2020 | $ | 200 | | 174 | 0,06 |
| 2,597 % fällig am 04.11.2019 | | 200 | | 176 | 0,06 |
| 2,681 % fällig am 09.01.2020 | | 300 | | 263 | 0,09 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | | |
| 0,132 % fällig am 16.12.2020 | € | 700 | | 701 | 0,24 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 0,578 % fällig am 04.12.2021 | | 600 | | 605 | 0,21 |
| **ING Bank NV** | | | | | |
| 0,110 % fällig am 26.11.2021 | | 1.000 | | 1.007 | 0,35 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | $ | 200 | | 189 | 0,07 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | | |
| 0,375 % fällig am 01.07.2024 | € | 200 | | 206 | 0,07 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 14.900 | | 2.027 | 0,69 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 47.404 | | 6.547 | 2,24 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 54 | | 8 | 0,00 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.04.2024 (c) | € | 600 | | 613 | 0,21 |
| 0,000 % fällig am 04.07.2024 (c) | | 1.200 | | 1.225 | 0,42 |
| 1,125 % fällig am 15.06.2037 | | 900 | | 1.005 | 0,34 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 25.03.2024 | | 600 | | 610 | 0,21 |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | £ | 600 | | 836 | 0,29 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | | |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | € | 300 | | 302 | 0,10 |
| **Nederlandse Waterschapsbank NV** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 29.01.2048 | | 600 | | 725 | 0,25 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 17.500 | | 2.400 | 0,82 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 8.693 | | 1.201 | 0,41 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 65 | | 9 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | | |
| 0,156 % fällig am 01.10.2022 | € | 100 | | 101 | 0,04 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 9 | | 1 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 12.861 | | 1.755 | 0,60 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 17.572 | | 2.428 | 0,83 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 125 | | 17 | 0,01 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,872 % fällig am 31.05.2021 | $ | 700 | € | 623 | 0,21 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | DKK | 70 | | 10 | 0,00 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (f)(h) | $ | 200 | | 180 | 0,06 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (f)(h) | | 200 | | 190 | 0,07 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | | |
| 0,232 % fällig am 15.12.2033 | € | 786 | | 761 | 0,26 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | $ | 100 | | 94 | 0,03 |
| **Telereal Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,010 % fällig am 10.12.2033 | £ | 826 | | 1.007 | 0,35 |
| **Temasek Financial Ltd.** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.03.2022 | € | 600 | | 612 | 0,21 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | | |
| 0,102 % fällig am 15.06.2021 | | 100 | | 100 | 0,03 |
| 0,625 % fällig am 08.09.2021 | | 600 | | 606 | 0,21 |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 300 | | 315 | 0,11 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | | |
| 0,140 % fällig am 06.07.2021 | | 200 | | 200 | 0,07 |
| 0,250 % fällig am 16.02.2021 | | 500 | | 502 | 0,17 |
| | | | | 44.660 | 15,30 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | | |
| **Barry Callebaut Services NV** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.06.2023 | $ | 400 | | 379 | 0,13 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 100 | | 92 | 0,03 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2022 | | 100 | | 89 | 0,03 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | | 200 | | 177 | 0,06 |
| **EMC Corp.** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 100 | | 87 | 0,03 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | | 100 | | 90 | 0,03 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | | |
| 2,350 % fällig am 15.10.2019 | | 200 | | 176 | 0,06 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 21.05.2021 | € | 400 | | 402 | 0,14 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b) | | 100 | | 102 | 0,04 |
| **MGM Resorts International** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | $ | 100 | | 92 | 0,03 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.07.2020 | | 100 | | 88 | 0,03 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 300 | | 274 | 0,09 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 200 | | 207 | 0,07 |
| **Smurfit Kappa Acquisitions ULC** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.01.2026 | | 200 | | 218 | 0,08 |
| **Stryker Corp.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2020 | | 500 | | 501 | 0,17 |
| **Syndicat Transport Ile de France EPA** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 25.05.2034 | | 1.900 | | 1.995 | 0,68 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | | |
| 0,237 % fällig am 21.11.2020 | | 1.200 | | 1.205 | 0,41 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | | |
| 1,239 % fällig am 16.11.2024 | | 300 | | 306 | 0,11 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | $ | 600 | | 530 | 0,18 |
| | | | | 7.010 | 2,40 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | | |
| **Exelon Corp.** | | | | | |
| 5,150 % fällig am 01.12.2020 | | 100 | | 90 | 0,03 |
| **Sprint Corp.** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 100 | | 94 | 0,03 |
| | | | | 184 | 0,06 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | | 51.854 | 17,76 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | | |
| 2,757 % fällig am 25.07.2037 | $ | 16 | € | 14 | 0,01 |
| 4,665 % fällig am 01.08.2036 | | 3 | | 3 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 18.000 | | 16.158 | 5,54 |
| **Freddie Mac** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2048 | | 4.381 | | 3.948 | 1,35 |
| **Freddie Mac, TBA** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2049 | | 6.000 | | 5.317 | 1,82 |
| | | | | 25.440 | 8,72 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | | 1.402 | | 1.233 | 0,42 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | | 439 | | 389 | 0,13 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | | 5.496 | | 5.031 | 1,72 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | | 5.606 | | 5.184 | 1,78 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | | 976 | | 961 | 0,33 |
| | | | | 12.798 | 4,38 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Alba PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2038 | € | 314 | | 298 | 0,10 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 4,118 % fällig am 25.07.2033 | $ | 11 | | 9 | 0,00 |
| **Bluestep Mortgage Securities DAC** | | | | | |
| 0,412 % fällig am 10.08.2066 | € | 345 | | 345 | 0,12 |
| 1,453 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 4.189 | | 398 | 0,14 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-through Certificates** | | | | | |
| 4,201 % fällig am 25.07.2033 | $ | 15 | | 14 | 0,00 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | | |
| 0,318 % fällig am 28.04.2051 | € | 941 | | 942 | 0,32 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | | |
| 0,936 % fällig am 15.06.2044 | £ | 304 | | 328 | 0,11 |
| **Eurosail PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | € | 395 | | 386 | 0,13 |
| 0,946 % fällig am 10.12.2044 | £ | 45 | | 50 | 0,02 |
| **F-E Mortgages SRL** | | | | | |
| 0,012 % fällig am 15.12.2043 | € | 18 | | 18 | 0,01 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | | |
| 0,139 % fällig am 15.02.2058 | | 1.100 | | 1.102 | 0,38 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | | 168 | | 166 | 0,06 |
| 2,532 % fällig am 18.06.2039 | $ | 59 | | 50 | 0,02 |
| **Landmark Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 0,986 % fällig am 17.06.2039 | £ | 254 | | 266 | 0,09 |
| 1,107 % fällig am 17.04.2044 | | 1.045 | | 1.094 | 0,37 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | | |
| 0,983 % fällig am 01.12.2060 | | 306 | | 325 | 0,11 |
| 1,001 % fällig am 01.01.2061 | | 124 | | 130 | 0,04 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | | |
| 0,282 % fällig am 15.12.2050 | € | 1.117 | | 1.081 | 0,37 |
| 0,916 % fällig am 15.12.2050 | £ | 167 | | 186 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,760 % fällig am 15.05.2045 (a) | | 800 | | 895 | 0,31 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 1,982 % fällig am 20.09.2065 | | 92 | | 103 | 0,04 |
| 3,055 % fällig am 14.02.2041 | | 271 | | 304 | 0,10 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | | 1.250 | | 1.396 | 0,48 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | | |
| 0,943 % fällig am 12.06.2044 | | 299 | | 315 | 0,11 |
| 0,963 % fällig am 12.06.2044 | | 931 | | 987 | 0,34 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.01.2070 | € | 1.008 | | 1.008 | 0,35 |
| 0,139 % fällig am 21.01.2070 | | 700 | | 701 | 0,24 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | | |
| 2,640 % fällig am 19.07.2035 | $ | 36 | | 31 | 0,01 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 3,044 % fällig am 25.09.2043 | | 44 | | 39 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 900 | | 1.010 | 0,35 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | | |
| 2,275 % fällig am 21.09.2049 | £ | 162 | € | 182 | 0,06 |
| | | | | 14.159 | 4,85 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Accunia European CLO BV** | | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 700 | | 701 | 0,24 |
| **Arbour CLO DAC** | | | | | |
| 0,580 % fällig am 15.03.2029 | | 300 | | 299 | 0,10 |
| 0,850 % fällig am 15.07.2027 | | 2.165 | | 2.166 | 0,74 |
| **Asset-Backed European Securitisation Transaction** | | | | | |
| 0,004 % fällig am 23.08.2030 | | 537 | | 539 | 0,19 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | | |
| 0,680 % fällig am 13.10.2029 | | 900 | | 898 | 0,31 |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | | |
| 0,012 % fällig am 20.10.2023 | | 64 | | 64 | 0,02 |
| 0,012 % fällig am 20.05.2024 | | 93 | | 93 | 0,03 |
| 0,012 % fällig am 20.06.2025 | | 561 | | 562 | 0,19 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | | | |
| 0,850 % fällig am 15.04.2027 | | 629 | | 629 | 0,22 |
| **Cairn CLO BV** | | | | | |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | | 1.100 | | 1.101 | 0,38 |
| 0,930 % fällig am 30.04.2031 | | 100 | | 100 | 0,03 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,730 % fällig am 21.09.2029 | | 500 | | 500 | 0,17 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | | |
| 0,780 % fällig am 16.04.2029 | | 400 | | 403 | 0,14 |
| **Castle Park CLO Designated Activity Co.** | | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.01.2028 | | 300 | | 301 | 0,10 |
| **Cork Street CLO Designated Activity Co.** | | | | | |
| 0,760 % fällig am 27.11.2028 | | 1.200 | | 1.208 | 0,41 |
| **CVC Cordatus Loan Fund Ltd.** | | | | | |
| 0,970 % fällig am 22.04.2030 | | 650 | | 653 | 0,22 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | | 400 | | 400 | 0,14 |
| 1,300 % fällig am 28.04.2029 | | 100 | | 100 | 0,03 |
| **Driver Multi-Compartment S.A.** | | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.02.2026 | | 173 | | 173 | 0,06 |
| 0,009 % fällig am 21.08.2026 | | 820 | | 823 | 0,28 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | | | |
| 0,718 % fällig am 17.05.2027 | | 299 | | 300 | 0,10 |
| **Duchess CLO BV** | | | | | |
| 1,033 % fällig am 28.02.2023 | | 404 | | 406 | 0,14 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | | 700 | | 700 | 0,24 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | | 400 | | 400 | 0,14 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | | |
| 0,609 % fällig am 15.11.2028 | | 697 | | 697 | 0,24 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Holland Park CLO Ltd.** | | | | | |
| 0,621 % fällig am 14.05.2027 | | 802 | | 803 | 0,28 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 3,109 % fällig am 25.01.2036 | $ | 1.000 | | 878 | 0,30 |
| **Penta CLO BV** | | | | | |
| 0,790 % fällig am 04.08.2028 | € | 1.000 | | 1.001 | 0,34 |
| **Purple Master Credit Cards** | | | | | |
| 0,052 % fällig am 25.10.2030 | € | 900 | € | 904 | 0,31 |
| **Red & Black Auto Lease Germany S.A.** | | | | | |
| 0,024 % fällig am 15.11.2027 | | 414 | | 414 | 0,14 |
| **SC Germany Auto UG** | | | | | |
| 0,023 % fällig am 13.12.2026 | | 122 | | 122 | 0,04 |
| **SCF Rahoituspalvelut Kimi DAC** | | | | | |
| 0,002 % fällig am 25.11.2026 | | 309 | | 309 | 0,11 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | | | |
| 0,074 % fällig am 17.03.2025 | | 234 | | 234 | 0,08 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2023 | | 30 | | 30 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 17.06.2024 | | 297 | | 297 | 0,10 |
| 0,232 % fällig am 15.12.2033 | | 232 | | 225 | 0,08 |
| **Sorrento Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,639 % fällig am 16.11.2027 | | 870 | | 871 | 0,30 |
| **St Paul's CLO DAC** | | | | | |
| 0,850 % fällig am 20.08.2030 | | 1.600 | | 1.601 | 0,55 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | | |
| 0,880 % fällig am 07.12.2029 (a) | | 1.100 | | 1.100 | 0,38 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | | |
| 0,900 % fällig am 15.10.2030 | | 1.200 | | 1.203 | 0,41 |
| **Towers CQ SRL** | | | | | |
| 0,607 % fällig am 28.12.2033 | | 190 | | 191 | 0,07 |
| **VCL Multi-Compartment S.A.** | | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.09.2023 | | 505 | | 506 | 0,17 |
| 0,009 % fällig am 21.01.2025 | | 464 | | 465 | 0,16 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,742 % fällig am 22.10.2031 | $ | 800 | | 702 | 0,24 |
| | | | | 26.072 | 8,93 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | | |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035 | € | 200 | | 241 | 0,08 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 1.600 | | 1.646 | 0,56 |
| **Belgium Government International Bond** | | | | | |
| 1,450 % fällig am 22.06.2037 | | 1.000 | | 1.141 | 0,39 |
| **CPPIB Capital, Inc.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.03.2033 | | 1.200 | | 1.359 | 0,47 |
| **Deposit Insurance Corp. of Japan** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 17.01.2020 | ¥ | 200.000 | | 1.631 | 0,56 |
| **Export-Import Bank of China** | | | | | |
| 0,300 % fällig am 06.03.2022 | € | 500 | | 505 | 0,17 |
| **Flemish Community** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 12.07.2038 | | 500 | | 561 | 0,19 |
| 1,500 % fällig am 11.04.2044 | | 1.000 | | 1.106 | 0,38 |
| **France Government International Bond** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 25.05.2050 | | 6.300 | | 7.253 | 2,49 |
| 1,750 % fällig am 25.06.2039 | | 7.100 | | 8.652 | 2,96 |
| 1,750 % fällig am 25.05.2066 | | 8.900 | | 10.948 | 3,75 |
| 2,000 % fällig am 25.05.2048 | | 16.500 | | 21.249 | 7,28 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 | | 8.900 | | 14.083 | 4,82 |
| 4,000 % fällig am 25.04.2055 | | 3.200 | | 6.109 | 2,09 |
| 4,000 % fällig am 25.04.2060 | | 2.900 | | 5.751 | 1,97 |
| 4,500 % fällig am 25.04.2041 | | 8.300 | | 14.891 | 5,10 |
| **Netherlands Government International Bond** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2047 | € | 7.000 | € | 11.540 | 3,95 |
| 3,750 % fällig am 15.01.2042 | | 100 | | 178 | 0,06 |
| **Region Wallonne Belgium** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 03.05.2034 | | 1.400 | | 1.510 | 0,52 |
| **Bundesrepublik Germany** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.08.2046 (j) | | 2.400 | | 3.830 | 1,31 |
| **Slovakia Government International Bond** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 12.06.2068 | | 300 | | 386 | 0,13 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 25.03.2035 | | 500 | | 560 | 0,19 |
| 1,750 % fällig am 03.11.2040 | | 1.900 | | 2.206 | 0,76 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 6.242 | | 6.171 | 2,11 |
| **SNCF Reseau** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 09.11.2031 | € | 400 | | 426 | 0,15 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 2,000 % fällig am 05.02.2048 (i) | | 1.800 | | 2.131 | 0,73 |
| **Spain Government International Bond** | | | | | |
| 1,400 % fällig am 30.04.2028 | | 100 | | 110 | 0,04 |
| 1,400 % fällig am 30.07.2028 | | 2.600 | | 2.852 | 0,98 |
| 1,450 % fällig am 31.10.2027 | | 1.000 | | 1.101 | 0,38 |
| 1,950 % fällig am 30.04.2026 | | 3.500 | | 3.949 | 1,35 |
| **Land Nordrhein-Westfalen** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 11.07.2068 | | 1.200 | | 1.461 | 0,50 |
| | | | | 135.537 | 46,42 |
| | | **AKTIEN** | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE TEILFONDS** | | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (g)** | | 284.670 | | 28.530 | 9,77 |
| | | **PARI (000S)** | | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | | |
| **Natwest Markets PLC** | | | | | |
| (0,243) % fällig am 31.03.2020 | € | 1.100 | | 1.102 | 0,38 |
| (0,193) % fällig am 27.09.2019 | | 700 | | 701 | 0,24 |
| | | | | 1.803 | 0,62 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (k)** | | | | 9.659 | 3,31 |
| **ITALY TREASURY BILLS** | | | | | |
| 0,655 % fällig am 14.11.2019 (c)(d) | | 5.300 | | 5.303 | 1,81 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | | 16.765 | 5,74 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **€** | **311.155** | **106,57** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 113,800 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 500 | € 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 134,500 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 47 | (1) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 25 | (55) | (0,02) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 20 | (35) | (0,01) |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2019 | 106 | (552) | (0,19) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 168 | 199 | 0,07 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 430 | 2.259 | 0,77 |

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 302 | € 744 | 0,26 |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09/2019 | 641 | (97) | (0,03) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 112,100 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 155 | 7 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 156,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 113 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 25 | 25 | 0,01 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 20 | 17 | 0,01 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 72 | (105) | (0,04) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 127 | (168) | (0,06) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 50 | 117 | 0,04 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 22 | 3 | 0,00 |
| | | | | € 2.358 | 0,81 |

[1] Future-Style-Option.

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | $ 103,000 | 23.08.2019 | 11 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| Put - U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | 105,000 | 23.08.2019 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 120,000 | 23.08.2019 | 5 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 122,000 | 23.08.2019 | 10 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 141,500 | 23.08.2019 | 14 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 144,000 | 23.08.2019 | 91 | 1 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 144,500 | 23.08.2019 | 89 | 1 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 145,500 | 23.08.2019 | 19 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 146,000 | 23.08.2019 | 36 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 147,000 | 23.08.2019 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 148,500 | 23.08.2019 | 6 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 149,500 | 23.08.2019 | 38 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 103,750 | 23.08.2019 | 5 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 103,875 | 23.08.2019 | 32 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 104,125 | 23.08.2019 | 210 | 2 | 1 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 107,500 | 23.08.2019 | 6 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 108,000 | 23.08.2019 | 122 | 1 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 127,750 | 23.08.2019 | 26 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,000 | 23.08.2019 | 65 | 1 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,250 | 23.08.2019 | 12 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,500 | 23.08.2019 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,750 | 23.08.2019 | 93 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | € 7 | € 1 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **€ 2.359** | **0,81** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | $ 1.500 | € 4 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.12.2021 | 200 | 2 | 0,00 |
| Renault SA | 1,000 | 20.12.2020 | € 1.400 | 3 | 0,00 |
| | | | | € 9 | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 21.12.2046 | $ 1.300 | € 140 | 0,05 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 18.700 | 78 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,000 | 19.12.2023 | ZAR 77.300 | 200 | 0,07 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.09.2021 | € 13.000 | (74) | (0,03) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | 15.400 | (41) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | 600 | (7) | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.12.2049 | 3.900 | 38 | 0,01 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | 500 | 50 | 0,02 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,750 | 15.03.2028 | 8.600 | 604 | 0,21 |

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 18.09.2049 | £ 1.000 | € 3 | 0,00 |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 2,000 | 15.03.2028 | 1.100 | (47) | (0,02) |
| | | | | | € 944 | 0,33 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ 953** | **0,33** |

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

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

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

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 % | 18.09.2019 | 8.100 | €(14) | € (2) | 0,00 |
| GST | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 3.800 | (7) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | €(21) | € (2) | 0,00 |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,776 % | 05.12.2019 | 3.500 | € (85) | € (384) | (0,13) |
| FBF | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,770 | 05.12.2019 | 3.600 | (81) | (392) | (0,13) |
| MYC | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,642 | 18.12.2019 | 3.600 | (72) | (313) | (0,11) |
| | | | | | | | €(238) | € (1.089) | (0,37) |

(1) 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 | 08/2019 | € | 777 | $ | 884 | € 0 | € (3) | € (3) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 1.098 | DKK | 8.196 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 3.963 | | 29.590 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.455 | ¥ | 177.800 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08/2019 | | 4.848 | $ | 5.460 | 0 | (71) | (71) | (0,03) |
| | 08/2019 | £ | 311 | € | 357 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.242 | | 1.963 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 9 | MXN | 175 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.431 | RUB | 93.456 | 36 | 0 | 36 | 0,01 |
| | 09/2019 | KRW | 959.791 | $ | 815 | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| | 10/2019 | MXN | 175 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | DKK | 1.535 | € | 206 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | $ | 106 | ZAR | 1.529 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | COP | 2.651.902 | $ | 832 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 1.725 | € | 231 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 16.119 | | 1.487 | 0 | (38) | (38) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 226 | RUB | 14.865 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 800 | IDR | 11.739.120 | 21 | 0 | 21 | 0,01 |
| | 10/2019 | | 829 | COP | 2.651.902 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 9 | MXN | 175 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 09/2019 | SGD | 1.046 | $ | 765 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 8.215 | € | 1.103 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | € | 1.437 | DKK | 10.725 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 13.792 | $ | 441 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | DKK | 18.095 | € | 2.425 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 780 | ZAR | 11.356 | 22 | 0 | 22 | 0,01 |
| | 08/2019 | € | 752 | SEK | 8.125 | 16 | 0 | 16 | 0,01 |
| | 08/2019 | $ | 393 | € | 347 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 4.431 | $ | 141 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | DKK | 11.205 | € | 1.502 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 365 | DKK | 2.725 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | € 4.161 | $ 4.686 | € 0 | € (61) | € (61) | (0,02) |
| RBC | 01/2020 | 1.358 | DKK 10.134 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RYL | 08/2019 | 379 | SEK 4.030 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | DKK 33.822 | € 4.532 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ 8.419 | 9.724 | 329 | 0 | 329 | 0,11 |
| | 08/2019 | ¥ 200.300 | 1.631 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD 5.530 | $ 177 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 01/2020 | DKK 10.000 | € 1.343 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € 214 | DKK 1.600 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 7.630 | € 6.760 | 84 | 0 | 84 | 0,03 |
| TOR | 07/2019 | 782 | COP 2.651.902 | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| UAG | 07/2019 | € 4.270 | DKK 31.875 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 36.253 | € 32.038 | 316 | 0 | 316 | 0,11 |
| | 10/2019 | DKK 31.875 | 4.272 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | € 902 | € (220) | € 682 | 0,23 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **€ (409)** | **(0,14)** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **€ 314.058** | **107,57** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **€ (22.099)** | **(7,57)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **€ 291.959** | **100,00** |

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

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

**(a) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(c) Nullkuponwertpapier.**

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

**(e) 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 und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 2.101 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von EUR 237 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von EUR 5.149 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**(j) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von EUR 587 und Barmittel in Höhe von EUR 260 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (0,580) % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | € 7.800 | SNCF Reseau 3,300 % fällig am 18.12.2042 | € (7.705) | € 7.800 | € 7.800 | 2,68 |
| FICC | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 181 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | (165) | 159 | 159 | 0,05 |
| RYL | (0,500) | 28.06.2019 | 01.07.2019 | € 1.700 | Republic of Germany 6,500 % fällig am 04.07.2027 | (1.708) | 1.700 | 1.700 | 0,58 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (9.578)** | **€ 9.659** | **€ 9.659** | **3,31** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 28.530 | € 282.625 | € 0 | € 311.155 |
| Finanzderivate[3] | 2.359 | 544 | 0 | 2.903 |
| **Summen** | **€ 30.889** | **€ 283.169** | **€ 0** | **€ 314.058** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 14.278 | € 252.554 | € 0 | € 266.832 |
| Finanzderivate[3] | 903 | 1.763 | 0 | 2.666 |
| **Summen** | **€ 15.181** | **€ 254.317** | **€ 0** | **€ 269.498** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (0,800) % | 04.06.2019 | TBD[1] | € (860) | € (860) | (0,30) |
| | (0,750) | 26.10.2018 | TBD[1] | (1.000) | (994) | (0,34) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **€ (1.854)** | **(0,64)** |

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/ verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (3) | € 0 | € (3) |
| BPS | (429) | 260 | (169) |
| BRC | (2) | 0 | (2) |
| CBK | 2 | 0 | 2 |
| FBF | (392) | 284 | (108) |
| GLM | (10) | 0 | (10) |
| HUS | (12) | 0 | (12) |
| JPM | 40 | 0 | 40 |
| MYC | (313) | 303 | (10) |
| MYI | (60) | 0 | (60) |
| RBC | 1 | 0 | 1 |
| RYL | 3 | 0 | 3 |
| SCX | 328 | (260) | 68 |
| SSB | 84 | 0 | 84 |
| TOR | 38 | 0 | 38 |
| UAG | 316 | (320) | (4) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 99,71 | 92,20 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 3,55 | 10,84 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 3,31 | 2,01 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,81 | 0,35 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,33 | 0,52 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,14) | 0,18 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,64) | (0,39) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 17,76 | 27,15 |
| US-Regierungsbehörden | 8,72 | 8,72 |
| US-Schatzobligationen | 4,38 | 0,81 |
| Non-Agency-MBS | 4,85 | 5,05 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 8,93 | 9,95 |
| Staatsemissionen | 46,42 | 43,38 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 9,77 | 5,62 |
| Kurzfristige Instrumente | 5,74 | 4,37 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,81 | 0,35 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Zinsswaps | 0,33 | 0,52 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoption | 0,00 | 0,17 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Zinsswapoption | (0,37) | (0,14) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | (0,06) |
| Devisenterminkontrakte | 0,23 | 0,21 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (7,57) | (6,10) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ASR Nederland NV** | | | | |
| 10,000 % fällig am 26.10.2019 (c) | € | 3.300 | € 3.410 | 1,02 |
| **Banca Carige SpA** | | | | |
| 1,389 % fällig am 25.10.2021 | | 3.400 | 3.439 | 1,03 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (c)(e) | | 1.000 | 1.029 | 0,31 |
| 8,875 % fällig am 14.04.2021 (c)(e) | | 400 | 447 | 0,13 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 28.09.2021 | | 2.800 | 2.882 | 0,86 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,034 % fällig am 21.09.2021 | | 800 | 801 | 0,24 |
| 0,491 % fällig am 07.02.2022 | | 3.700 | 3.726 | 1,11 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (c)(e) | | 1.900 | 2.009 | 0,60 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (e) | $ | 200 | 192 | 0,06 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 300 | 386 | 0,11 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 23.03.2021 | € | 4.800 | 4.948 | 1,48 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (c)(e) | | 800 | 867 | 0,26 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.06.2022 | | 1.800 | 1.834 | 0,55 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | | 1.100 | 1.149 | 0,34 |
| 2,375 % fällig am 01.02.2024 | | 1.000 | 1.071 | 0,32 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 29.01.2022 | | 300 | 304 | 0,09 |
| **Cloverie PLC for Zurich Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 24.07.2039 | | 1.000 | 1.005 | 0,30 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (c)(e) | | 700 | 730 | 0,22 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (c)(e) | | 600 | 666 | 0,20 |
| **Corp. Andina de Fomento** | | | | |
| 1,000 % fällig am 10.11.2020 | | 1.500 | 1.522 | 0,45 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | | 1.300 | 1.320 | 0,39 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.09.2021 | | 2.800 | 2.870 | 0,86 |
| **Danske Bank A/S** | | | | |
| 0,125 % fällig am 14.02.2022 | | 3.300 | 3.343 | 1,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,375 % fällig am 18.01.2021 | | 600 | 594 | 0,18 |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | | 1.800 | 1.828 | 0,54 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | $ | 2.800 | 2.493 | 0,74 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.01.2021 | € | 14.300 | 14.858 | 4,43 |
| **Erste Abwicklungsanstalt** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.06.2020 (b) | | 3.500 | 3.517 | 1,05 |
| **Europäischer Stabilitätsmechanismus** | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.01.2022 (b) | | 2.100 | 2.130 | 0,64 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 19.11.2020 | £ | 1.800 | 2.047 | 0,61 |
| **FMS Wertmanagement** | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.09.2021 | € | 3.800 | 4.101 | 1,22 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | | 400 | 396 | 0,12 |
| **GE Capital European Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 03.11.2021 | | 2.200 | 2.420 | 0,72 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 13.09.2023 | £ | 200 | 241 | 0,07 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 0,372 % fällig am 10.05.2021 | € | 1.600 | 1.606 | 0,48 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,688 % fällig am 27.07.2021 | | 3.500 | 3.551 | 1,06 |
| 4,750 % fällig am 12.10.2021 | | 1.300 | 1.436 | 0,43 |
| **Hamburg Commercial Bank AG** | | | | |
| 0,250 % fällig am 25.04.2022 | | 4.500 | 4.573 | 1,36 |
| **HBOS PLC** | | | | |
| 5,374 % fällig am 30.06.2021 | | 2.700 | 2.968 | 0,88 |
| **Hutchison Whampoa Finance Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 31.10.2021 | € | 5.700 | € 5.885 | 1,75 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 0,240 % fällig am 12.10.2020 | | 2.300 | 2.300 | 0,69 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.04.2022 (b) | | 1.600 | 1.605 | 0,48 |
| 0,090 % fällig am 08.04.2022 | | 1.600 | 1.609 | 0,48 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.11.2021 | | 3.800 | 3.946 | 1,18 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK | 15.100 | 2.031 | 0,61 |
| **KOFIBA-Kommunalfinanzierungsbank GmbH** | | | | |
| 0,375 % fällig am 03.03.2022 | € | 3.300 | 3.366 | 1,00 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.06.2021 (b) | | 2.200 | 2.227 | 0,66 |
| 0,000 % fällig am 30.06.2022 (b) | | 5.000 | 5.085 | 1,52 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 0,211 % fällig am 04.11.2020 | | 1.600 | 1.603 | 0,48 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.07.2020 | | 4.000 | 4.038 | 1,20 |
| 1,375 % fällig am 16.04.2021 | | 2.700 | 2.785 | 0,83 |
| 6,500 % fällig am 24.03.2020 | | 1.300 | 1.360 | 0,41 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.04.2021 | | 300 | 303 | 0,09 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,087 % fällig am 21.05.2021 | | 200 | 200 | 0,06 |
| 5,375 % fällig am 10.08.2020 | | 1.400 | 1.486 | 0,44 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 6,750 % fällig am 22.07.2020 | | 1.400 | 1.499 | 0,45 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | | 1.800 | 1.810 | 0,54 |
| 0,625 % fällig am 02.03.2022 | | 700 | 704 | 0,21 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,156 % fällig am 01.10.2022 | | 3.500 | 3.544 | 1,06 |
| 1,000 % fällig am 01.01.2020 | DKK | 21.500 | 2.904 | 0,87 |
| 1,000 % fällig am 01.04.2020 | | 8.400 | 1.139 | 0,34 |
| 1,000 % fällig am 01.04.2020 | € | 200 | 202 | 0,06 |
| 1,000 % fällig am 01.07.2020 | DKK | 19.400 | 2.641 | 0,79 |
| **PKO Bank Hipoteczny S.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 23.11.2021 | € | 4.100 | 4.141 | 1,23 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | $ | 1.700 | 1.496 | 0,45 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 0,121 % fällig am 06.08.2020 | € | 200 | 201 | 0,06 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (c)(e) | $ | 400 | 361 | 0,11 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (c)(e) | | 800 | 759 | 0,23 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 16.07.2020 | € | 600 | 617 | 0,18 |
| 4,250 % fällig am 12.04.2021 | | 2.400 | 2.599 | 0,77 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 19.02.2021 | | 500 | 508 | 0,15 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.12.2020 | | 400 | 415 | 0,12 |
| **UBS AG** | | | | |
| 4,000 % fällig am 08.04.2022 | | 3.000 | 3.363 | 1,00 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,159 % fällig am 01.08.2022 | | 300 | 305 | 0,09 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,625 % fällig am 01.04.2022 | | 2.200 | 2.220 | 0,66 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 0,140 % fällig am 06.07.2021 | | 600 | 599 | 0,18 |
| 0,500 % fällig am 20.06.2022 | | 3.500 | 3.517 | 1,05 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.12.2020 | | 700 | 717 | 0,21 |
| 3,625 % fällig am 08.10.2021 | | 800 | 868 | 0,26 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | |
| 0,750 % fällig am 10.11.2022 | | 3.200 | 3.308 | 0,99 |
| | | | 168.975 | 50,40 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 4,249 % fällig am 31.07.2043 | £ | 102 | 116 | 0,03 |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | | | |
| 1,750 % fällig am 18.03.2021 | € | 800 | 825 | 0,25 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 0,189 % fällig am 16.08.2021 | € | 4.000 | € 3.999 | 1,19 |
| **Bayer AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 25.01.2021 | | 200 | 205 | 0,06 |
| **Bayer Capital Corp. BV** | | | | |
| 0,207 % fällig am 26.06.2022 | | 3.800 | 3.787 | 1,13 |
| **Becton Dickinson Euro Finance SARL** | | | | |
| 0,174 % fällig am 04.06.2021 | | 400 | 402 | 0,12 |
| **BMW Finance NV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 13.07.2022 | | 1.300 | 1.305 | 0,39 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 0,125 % fällig am 21.05.2021 | | 100 | 100 | 0,03 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 17.05.2022 | | 1.300 | 1.308 | 0,39 |
| 1,250 % fällig am 26.05.2023 | | 1.400 | 1.445 | 0,43 |
| **Imerys S.A.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.11.2020 | | 1.000 | 1.031 | 0,31 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 26.02.2021 | | 3.200 | 3.304 | 0,99 |
| **Indonesia Asahan Aluminium Persero PT** | | | | |
| 5,230 % fällig am 15.11.2021 | $ | 500 | 463 | 0,14 |
| **Mylan NV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 23.11.2020 | € | 3.555 | 3.596 | 1,07 |
| **Origin Energy Finance Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 23.10.2020 | | 3.100 | 3.205 | 0,96 |
| **ProSiebenSat.1 Media SE** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2021 | | 2.900 | 3.007 | 0,90 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | | 2.900 | 3.007 | 0,90 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.11.2021 | | 5.000 | 5.160 | 1,54 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 21.11.2020 | | 300 | 302 | 0,09 |
| 0,787 % fällig am 21.11.2022 | | 1.200 | 1.224 | 0,36 |
| 1,125 % fällig am 21.11.2022 | | 300 | 311 | 0,09 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | | |
| 1,477 % fällig am 14.09.2021 | | 3.500 | 3.628 | 1,08 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 0,375 % fällig am 25.07.2020 | | 1.000 | 984 | 0,29 |
| **UCB S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 27.03.2020 | | 380 | 390 | 0,12 |
| 4,125 % fällig am 04.01.2021 | | 100 | 106 | 0,03 |
| | | | 43.210 | 12,89 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 17.12.2021 | | 3.700 | 3.924 | 1,17 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 0,625 % fällig am 10.03.2021 | | 4.400 | 4.455 | 1,33 |
| **CNOOC Curtis Funding No. 1 Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.10.2020 | | 700 | 724 | 0,21 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 26.02.2021 | | 3.200 | 3.379 | 1,01 |
| **Global Switch Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 13.12.2022 | £ | 200 | 242 | 0,07 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 17.10.2020 | € | 1.200 | 1.241 | 0,37 |
| | | | 13.965 | 4,16 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 226.150 | 67,45 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Bluestep Mortgage Securities DAC** | | | | |
| 1,453 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 1.140 | 109 | 0,03 |
| **Cartesian Residential Mortgages S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.11.2051 | € | 3.182 | 3.176 | 0,95 |
| **Domi BV** | | | | |
| 0,553 % fällig am 15.06.2051 | | 700 | 701 | 0,21 |
| **Duncan Funding PLC** | | | | |
| 0,090 % fällig am 17.04.2063 | | 95 | 95 | 0,03 |
| 0,162 % fällig am 17.12.2062 | | 3.600 | 3.605 | 1,07 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,368 % fällig am 28.01.2048 | | 3.134 | 3.141 | 0,94 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | | 2.671 | 2.610 | 0,78 |
| 0,035 % fällig am 13.03.2045 | | 1.151 | 1.137 | 0,34 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Low Duration Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Finsbury Square PLC** | | | | | |
| 1,443 % fällig am 12.09.2065 | £ | 1.468 | € | 1.640 | 0,49 |
| 1,473 % fällig am 12.09.2065 | | 1.088 | | 1.216 | 0,36 |
| 1,743 % fällig am 12.09.2068 | | 1.451 | | 1.627 | 0,48 |
| 1,910 % fällig am 16.06.2069 | | 1.250 | | 1.400 | 0,42 |
| **FT RMBS Prado** | | | | | |
| 0,142 % fällig am 15.03.2056 | € | 3.599 | | 3.604 | 1,07 |
| 0,582 % fällig am 17.03.2056 | | 2.962 | | 2.988 | 0,89 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | | |
| 0,139 % fällig am 15.02.2058 | | 600 | | 601 | 0,18 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | | 84 | | 83 | 0,02 |
| **Grecale ABS SRL** | | | | | |
| 0,070 % fällig am 28.04.2056 | | 130 | | 129 | 0,04 |
| **Harben Finance PLC** | | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | £ | 1.014 | | 1.132 | 0,34 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | | |
| 2,195 % fällig am 25.05.2053 | | 258 | | 289 | 0,09 |
| **Lanark Master Issuer PLC** | | | | | |
| 0,136 % fällig am 22.12.2054 | € | 2.743 | | 2.745 | 0,82 |
| **Mulcair Securities DAC** | | | | | |
| 0,695 % fällig am 24.04.2071 | | 200 | | 200 | 0,06 |
| **Oncilla Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 2,193 % fällig am 12.12.2043 | £ | 433 | | 487 | 0,14 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 1,582 % fällig am 20.03.2050 | | 2.928 | | 3.268 | 0,97 |
| **SapphireOne Mortgages FCT** | | | | | |
| 0,156 % fällig am 27.06.2061 | € | 2.592 | | 2.607 | 0,78 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | | |
| 0,139 % fällig am 21.01.2070 | | 3.540 | | 3.546 | 1,06 |
| **Storm BV** | | | | | |
| 0,286 % fällig am 22.05.2064 | | 1.700 | | 1.720 | 0,51 |
| **Taurus DEU DAC** | | | | | |
| 1,280 % fällig am 03.01.2027 | | 57 | | 57 | 0,02 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 2.200 | | 2.468 | 0,74 |
| | | | | 46.381 | 13,83 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Arbour CLO DAC** | | | | | |
| 0,580 % fällig am 15.03.2029 | € | 800 | | 798 | 0,24 |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | € | 3.000 | € | 3.000 | 0,89 |
| **Cairn CLO BV** | | | | | |
| 0,930 % fällig am 30.04.2031 | | 100 | | 100 | 0,03 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,870 % fällig am 18.01.2030 | | 4.450 | | 4.450 | 1,33 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | | |
| 0,780 % fällig am 16.04.2029 | | 300 | | 302 | 0,09 |
| **Cork Street CLO Designated Activity Co.** | | | | | |
| 0,760 % fällig am 27.11.2028 | | 900 | | 906 | 0,27 |
| **CVC Cordatus Loan Fund Ltd.** | | | | | |
| 0,970 % fällig am 22.04.2030 | | 2.000 | | 2.009 | 0,60 |
| **Driver Espana FT** | | | | | |
| 0,011 % fällig am 21.04.2028 | | 106 | | 107 | 0,03 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | | | |
| 0,880 % fällig am 15.01.2030 | | 3.500 | | 3.504 | 1,04 |
| **Duchess CLO BV** | | | | | |
| 1,033 % fällig am 28.02.2023 | | 202 | | 203 | 0,06 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | | 400 | | 400 | 0,12 |
| **Euro-Galaxy CLO BV** | | | | | |
| 1,140 % fällig am 10.11.2030 | | 200 | | 200 | 0,06 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | | 500 | | 500 | 0,15 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | | 300 | | 299 | 0,09 |
| 0,530 % fällig am 12.07.2028 | | 400 | | 400 | 0,12 |
| **Sorrento Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,639 % fällig am 16.11.2027 | | 677 | | 678 | 0,20 |
| **Sunrise SPV** | | | | | |
| 0,171 % fällig am 27.06.2041 | | 671 | | 671 | 0,20 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | | |
| 0,880 % fällig am 07.12.2029 (a) | | 1.900 | | 1.900 | 0,57 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | | |
| 0,900 % fällig am 15.10.2030 | | 1.400 | | 1.403 | 0,42 |
| **Tymon Park CLO Ltd.** | | | | | |
| 0,590 % fällig am 21.01.2029 | | 300 | | 299 | 0,09 |
| **VCL Multi-Compartment S.A.** | | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.01.2025 | | 185 | | 186 | 0,06 |
| | | | | 22.315 | 6,66 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 30.04.2022 | € | 1.500 | € | 1.523 | 0,45 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | | 200 | | 216 | 0,06 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 5.400 | | 5.554 | 1,66 |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | | |
| 0,747 % fällig am 30.04.2022 | | 5.300 | | 5.448 | 1,63 |
| **Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 25.04.2021 | | 4.900 | | 5.253 | 1,57 |
| **China Development Bank** | | | | | |
| 0,375 % fällig am 24.01.2022 | | 1.750 | | 1.768 | 0,53 |
| **Export-Import Bank of China** | | | | | |
| 0,300 % fällig am 06.03.2022 | | 2.000 | | 2.020 | 0,60 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 22.09.2021 | | 3.000 | | 3.081 | 0,92 |
| **Serbia Government International Bond** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 25.02.2020 | $ | 339 | | 302 | 0,09 |
| | | | | 25.165 | 7,51 |
| | | AKTIEN | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (d)** | | 119.200 | | 11.946 | 3,56 |
| | | PARI (000S) | | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | | |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 0,081 % fällig am 19.08.2019 | € | 1.000 | | 1.001 | 0,30 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (f)** | | | | | |
| | | | | 837 | 0,25 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | | 1.838 | 0,55 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **€** | **333.795** | **99,56** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month Euribor December Futures | Long | 12/2021 | 244 | € 192 | 0,06 |
| 3-Month Euribor June Futures | Long | 06/2021 | 29 | 21 | 0,01 |
| 3-Month Euribor March Futures | Long | 03/2022 | 244 | 199 | 0,06 |
| 3-Month Euribor September Futures | Long | 09/2021 | 244 | 186 | 0,06 |
| 90-Day Eurodollar December Futures | Long | 12/2021 | 152 | 40 | 0,01 |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Long | 09/2022 | 226 | (17) | (0,01) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 171,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[(1)] | Short | 07/2019 | 23 | (34) | (0,01) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 171,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[(1)] | Short | 08/2019 | 23 | (30) | (0,01) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 133,500 EUR auf Euro-Bobl August 2019 Futures[(1)] | Short | 07/2019 | 55 | 7 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[(1)] | Short | 07/2019 | 23 | 11 | 0,01 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 429 | 170 | 0,05 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 102 | (92) | (0,03) |
| | | | | € 653 | 0,20 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ 653** | **0,20** |

(1) Future-Style-Option.

**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 | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 % | 18.09.2019 | 9.300 | €(12) | € (2) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 9.300 | (15) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | €(27) | € (5) | 0,00 |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | $ 1.300 | € 2 | € 0 | € 2 | 0,00 |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 326 | € | 286 | € 0 | € 0 | € 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5.537 | HUF | 1.519.862 | 0 | (150) | (150) | (0,05) |
| BPS | 07/2019 | € | 1.398 | $ | 1.580 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 220 | € | 193 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 580 | £ | 518 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 83 | € | 95 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1 | MXN | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 980 | RUB | 63.985 | 24 | 0 | 24 | 0,01 |
| | 10/2019 | MXN | 26 | $ | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | € | 4.825 | | 5.483 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.977 | CHF | 3.341 | 34 | 0 | 34 | 0,01 |
| | 08/2019 | $ | 5.497 | € | 4.825 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 1 | MXN | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | COP | 2.991.598 | $ | 939 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.859 | HUF | 526.669 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 119 | € | 133 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 3.972 | | 366 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 931 | IDR | 13.655.903 | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| | 10/2019 | | 935 | COP | 2.991.598 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | HUF | 2.000.484 | $ | 7.268 | 181 | 0 | 181 | 0,05 |
| | 07/2019 | $ | 944 | ZAR | 13.749 | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| | 08/2019 | € | 178 | SEK | 1.920 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| MYI | 10/2019 | DKK | 15.290 | € | 2.051 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 01/2020 | | 21.805 | | 2.926 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 04/2020 | | 8.500 | | 1.141 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2020 | | 19.905 | | 2.673 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 08/2019 | CHF | 3.270 | | 2.891 | 0 | (56) | (56) | (0,02) |
| | 08/2019 | £ | 15.349 | | 17.728 | 599 | 0 | 599 | 0,18 |
| | 08/2019 | ¥ | 86.100 | | 698 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| SSB | 08/2019 | € | 702 | ¥ | 86.100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ | 883 | COP | 2.991.598 | 43 | 0 | 43 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 6.638 | € | 5.936 | 107 | 0 | 107 | 0,03 |
| | | | | | | € 1.065 | € (248) | € 817 | 0,24 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **€** | **814** | **0,24** |
| **Summe Anlagen** | **€** | **335.262** | **100,00** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **€** | **15** | **0,00** |
| **Nettovermögen** | **€** | **335.277** | **100,00** |

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

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

**(a) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(b) Nullkuponwertpapier.**

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

**(d) Mit dem Fonds verbunden.**

**(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**Barmittel in Höhe von EUR 453 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von EUR 290 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(f) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 953 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | € (854) | € 837 | € 837 | 0,25 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (854)** | **€ 837** | **€ 837** | **0,25** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 11.946 | € 321.849 | € 0 | € 333.795 |
| Finanzderivate[3] | 653 | 814 | 0 | 1.467 |
| **Summen** | **€ 12.599** | **€ 322.663** | **€ 0** | **€ 335.262** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 13.060 | € 296.511 | € 0 | € 309.571 |
| Finanzderivate[3] | 866 | (633) | 0 | 233 |
| **Summen** | **€ 13.926** | **€ 295.878** | **€ 0** | **€ 309.804** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/ verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (150) | € 290 | € 140 |
| BPS | 14 | 0 | 14 |
| BRC | (2) | 0 | (2) |
| CBK | 34 | 0 | 34 |
| CKL | (3) | 0 | (3) |
| GLM | 15 | 0 | 15 |
| HUS | 2 | 0 | 2 |
| JPM | 212 | (316) | (104) |
| MYI | 2 | 0 | 2 |
| SCX | 540 | (540) | 0 |
| TOR | 150 | 0 | 150 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 98,87 | 98,06 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 0,44 | 0,00 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,25 | 0,55 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,20 | 0,27 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,00 | (0,08) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,24 | (0,12) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 67,45 | 65,14 |
| Non-Agency-MBS | 13,83 | 12,43 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 6,66 | 3,37 |
| Staatsemissionen | 7,51 | 12,48 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 3,56 | 4,16 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,55 | 1,03 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,20 | 0,27 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Zinsswaps | 0,00 | (0,08) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,01) |
| Devisenterminkontrakte | 0,24 | (0,11) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,00 | 1,32 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ASR Nederland NV** | | | | |
| 10,000 % fällig am 26.10.2019 (c) | € | 2.500 | € 2.583 | 0,36 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 3,253 % fällig am 30.07.2021 | $ | 200 | 175 | 0,02 |
| **Banca Carige SpA** | | | | |
| 1,389 % fällig am 25.10.2021 | € | 7.000 | 7.079 | 0,99 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,034 % fällig am 21.09.2021 | | 8.200 | 8.211 | 1,15 |
| 1,375 % fällig am 10.09.2021 | | 2.700 | 2.789 | 0,39 |
| **Bank of China Ltd.** | | | | |
| 0,156 % fällig am 22.11.2020 | | 700 | 699 | 0,10 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 1,250 % fällig am 09.04.2020 | | 1.000 | 1.011 | 0,14 |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (c)(d) | | 200 | 211 | 0,03 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 19.09.2019 | | 8.000 | 8.039 | 1,13 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (d) | $ | 400 | 384 | 0,05 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 23.03.2021 | € | 1.600 | 1.649 | 0,23 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (c)(d) | | 200 | 217 | 0,03 |
| **Berkshire Hathaway, Inc.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 13.03.2020 | | 2.000 | 2.010 | 0,28 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 0,242 % fällig am 11.11.2019 | | 8.700 | 8.716 | 1,22 |
| **Cloverie PLC for Zurich Insurance Co. Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 24.07.2039 | | 2.000 | 2.009 | 0,28 |
| **CNP Assurances** | | | | |
| 6,000 % fällig am 14.09.2040 | | 3.400 | 3.652 | 0,51 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 0,386 % fällig am 27.11.2019 | SEK | 34.000 | 4.168 | 0,59 |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (c)(d) | € | 200 | 208 | 0,03 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (c)(d) | | 600 | 665 | 0,09 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 14.04.2022 | | 2.000 | 2.070 | 0,29 |
| 2,750 % fällig am 26.03.2020 | $ | 4.600 | 4.047 | 0,57 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,180 % fällig am 07.12.2020 | € | 1.300 | 1.285 | 0,18 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 3.900 | 3.934 | 0,55 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2020 | £ | 200 | 223 | 0,03 |
| **Deutsche Hypothekenbank AG** | | | | |
| 1,043 % fällig am 22.03.2021 | | 6.400 | 7.150 | 1,00 |
| **Deutsche Pfandbriefbank AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 20.12.2019 | | 900 | 1.010 | 0,14 |
| **Euroclear Bank S.A.** | | | | |
| 0,040 % fällig am 10.07.2020 | € | 400 | 401 | 0,06 |
| 0,077 % fällig am 08.03.2021 | | 1.700 | 1.707 | 0,24 |
| **Europäischer Stabilitätsmechanismus** | | | | |
| 0,875 % fällig am 15.10.2019 | | 20.000 | 20.081 | 2,82 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | $ | 8.200 | 7.245 | 1,02 |
| **FMS Wertmanagement** | | | | |
| 0,000 % fällig am 20.10.2020 (a) | € | 100 | 101 | 0,01 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | | 7.600 | 7.518 | 1,06 |
| 3,484 % fällig am 12.10.2021 | $ | 3.200 | 2.767 | 0,39 |
| **GE Capital European Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 0,069 % fällig am 21.01.2020 | € | 5.600 | 5.603 | 0,79 |
| 2,250 % fällig am 20.07.2020 | | 2.200 | 2.254 | 0,32 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 0,207 % fällig am 26.03.2022 | | 5.300 | 5.232 | 0,73 |
| 0,372 % fällig am 10.05.2021 | | 4.300 | 4.316 | 0,61 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,132 % fällig am 16.12.2020 | | 3.300 | 3.304 | 0,46 |
| 0,389 % fällig am 29.05.2020 | | 4.700 | 4.723 | 0,66 |
| 0,438 % fällig am 29.10.2019 | | 2.800 | 2.806 | 0,39 |
| **HSBC France S.A.** | | | | |
| 0,200 % fällig am 04.09.2021 | | 2.600 | 2.620 | 0,37 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 0,287 % fällig am 23.05.2020 | | 800 | 801 | 0,11 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 0,090 % fällig am 26.11.2020 | € | 3.600 | € 3.614 | 0,51 |
| 0,090 % fällig am 08.04.2022 | | 1.900 | 1.910 | 0,27 |
| 3,625 % fällig am 25.02.2026 | | 3.600 | 3.803 | 0,53 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK | 33.000 | 4.439 | 0,62 |
| **Landesbank Baden-Wuerttemberg** | | | | |
| 1,074 % fällig am 18.05.2021 | £ | 3.100 | 3.465 | 0,49 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 0,500 % fällig am 22.07.2020 | € | 11.300 | 11.408 | 1,60 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.04.2021 | | 2.900 | 2.925 | 0,41 |
| **Mercedes-Benz Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 0,100 % fällig am 20.11.2020 | | 7.900 | 7.914 | 1,11 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,072 % fällig am 09.11.2021 | | 5.700 | 5.705 | 0,80 |
| 0,087 % fällig am 21.05.2021 | | 2.600 | 2.604 | 0,37 |
| 0,392 % fällig am 08.11.2022 | | 600 | 603 | 0,09 |
| **National Westminster Bank PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 19.10.2020 | | 2.200 | 2.322 | 0,33 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | |
| 0,080 % fällig am 02.03.2020 | | 800 | 801 | 0,11 |
| **NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank** | | | | |
| 0,250 % fällig am 10.03.2020 | | 2.200 | 2.209 | 0,31 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.01.2020 | DKK | 62.900 | 8.503 | 1,19 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.01.2020 | | 2.711 | 366 | 0,05 |
| 1,000 % fällig am 01.04.2020 | | 18.200 | 2.468 | 0,35 |
| **PKO Bank Hipoteczny S.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 23.11.2021 | € | 400 | 404 | 0,06 |
| **Prologis LP** | | | | |
| 1,375 % fällig am 07.10.2020 | | 4.400 | 4.471 | 0,63 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,872 % fällig am 31.05.2021 | $ | 7.400 | 6.588 | 0,92 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 5.600 | 4.930 | 0,69 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (c)(d) | | 300 | 271 | 0,04 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (c)(d) | | 300 | 285 | 0,04 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 12.04.2021 | € | 6.700 | 7.255 | 1,02 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 3,352 % fällig am 15.11.2019 | | 2.900 | 2.938 | 0,41 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 3,539 % fällig am 06.04.2020 | $ | 4.100 | 3.609 | 0,51 |
| **UBS AG** | | | | |
| 0,189 % fällig am 23.04.2021 | € | 7.500 | 7.547 | 1,06 |
| 0,190 % fällig am 10.01.2020 | | 2.000 | 2.004 | 0,28 |
| **Unibail-Rodamco SE** | | | | |
| 0,125 % fällig am 14.05.2021 | | 2.000 | 2.010 | 0,28 |
| **Virgin Money PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.04.2020 | £ | 1.600 | 1.802 | 0,25 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,040 % fällig am 11.10.2019 | € | 7.200 | 7.204 | 1,01 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 0,038 % fällig am 20.11.2019 | | 2.600 | 2.601 | 0,37 |
| 0,875 % fällig am 30.03.2020 | | 2.000 | 2.015 | 0,28 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 0,100 % fällig am 02.06.2020 | | 6.600 | 6.618 | 0,93 |
| 2,250 % fällig am 03.09.2020 | | 2.000 | 2.057 | 0,29 |
| | | | 275.341 | 38,63 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **ABB Finance BV** | | | | |
| 0,040 % fällig am 12.10.2020 | | 3.400 | 3.410 | 0,48 |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 18.11.2019 | | 5.500 | 5.510 | 0,77 |
| **Allergan Funding SCS** | | | | |
| 0,039 % fällig am 15.11.2020 | | 1.700 | 1.699 | 0,24 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 13.09.2019 | | 5.100 | 5.125 | 0,72 |
| **Anheuser-Busch InBev S.A.** | | | | |
| 0,432 % fällig am 17.03.2020 | | 3.900 | 3.920 | 0,55 |
| 0,625 % fällig am 17.03.2020 | | 3.900 | 3.922 | 0,55 |
| **AP Moller-Maersk A/S** | | | | |
| 1,750 % fällig am 18.03.2021 | € | 2.700 | € 2.786 | 0,39 |
| 3,375 % fällig am 28.08.2019 | | 6.442 | 6.477 | 0,91 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 0,189 % fällig am 16.08.2021 | | 3.600 | 3.599 | 0,51 |
| 3,398 % fällig am 15.08.2022 | $ | 100 | 88 | 0,01 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | | 100 | 88 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 07.07.2020 | € | 1.000 | 1.041 | 0,15 |
| **Bayer Capital Corp. BV** | | | | |
| 0,207 % fällig am 26.06.2022 | | 800 | 797 | 0,11 |
| **BMW Finance NV** | | | | |
| 0,125 % fällig am 13.07.2022 | | 2.500 | 2.510 | 0,35 |
| **Braskem Finance Ltd.** | | | | |
| 6,450 % fällig am 03.02.2024 | $ | 2.388 | 2.323 | 0,33 |
| **Braskem Netherlands Finance BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 10.01.2023 | | 700 | 619 | 0,09 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,040 % fällig am 15.03.2021 | | 400 | 351 | 0,05 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 200 | 177 | 0,03 |
| **Coca-Cola European Partners PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 05.12.2019 | € | 800 | 804 | 0,11 |
| **Constellation Brands, Inc.** | | | | |
| 3,218 % fällig am 15.11.2021 | $ | 200 | 176 | 0,02 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 0,040 % fällig am 03.04.2020 | € | 5.200 | 5.210 | 0,73 |
| **Diageo Finance PLC** | | | | |
| 0,250 % fällig am 22.10.2021 | | 1.300 | 1.312 | 0,18 |
| **ELM BV for RELX Finance BV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 24.09.2020 | | 2.000 | 2.065 | 0,29 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 31.01.2020 | $ | 1.102 | 983 | 0,14 |
| **Essity AB** | | | | |
| 0,500 % fällig am 05.03.2020 | € | 2.700 | 2.708 | 0,38 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 0,125 % fällig am 21.05.2021 | | 300 | 301 | 0,04 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.05.2020 | | 2.600 | 2.600 | 0,37 |
| **General Mills, Inc.** | | | | |
| 0,420 % fällig am 15.01.2020 | | 4.400 | 4.413 | 0,62 |
| 3,598 % fällig am 17.10.2023 | $ | 100 | 89 | 0,01 |
| **Harris Corp.** | | | | |
| 3,063 % fällig am 30.04.2020 | | 100 | 88 | 0,01 |
| **INEOS Grangemouth PLC** | | | | |
| 0,750 % fällig am 30.07.2019 | € | 2.900 | 2.912 | 0,41 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 25.09.2021 | | 1.900 | 1.924 | 0,27 |
| **ISS Global A/S** | | | | |
| 1,125 % fällig am 09.01.2020 | | 4.700 | 4.716 | 0,66 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 02.07.2020 | $ | 400 | 352 | 0,05 |
| **McDonald's Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 26.08.2019 | € | 1.500 | 1.501 | 0,21 |
| **Medtronic Global Holdings S.C.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 07.03.2021 | | 5.300 | 5.315 | 0,75 |
| **Mylan NV** | | | | |
| 0,189 % fällig am 24.05.2020 | | 7.500 | 7.487 | 1,05 |
| **National Express Group PLC** | | | | |
| 0,089 % fällig am 15.05.2020 | | 1.000 | 1.001 | 0,14 |
| **Origin Energy Finance Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 11.10.2019 | | 1.800 | 1.816 | 0,26 |
| **Philip Morris International, Inc.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 19.03.2020 | | 4.800 | 4.868 | 0,68 |
| **ProSiebenSat.1 Media SE** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2021 | | 1.400 | 1.451 | 0,20 |
| **Safran S.A.** | | | | |
| 0,020 % fällig am 13.07.2020 | | 1.800 | 1.800 | 0,25 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | | 9.600 | 9.953 | 1,40 |
| **Sky Ltd.** | | | | |
| 0,406 % fällig am 01.04.2020 | | 7.100 | 7.129 | 1,00 |
| **Stryker Corp.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2020 | | 500 | 501 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Symrise AG** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 10.07.2019 | € | 1.050 | € | 1.051 | 0,15 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | $ | 200 | | 177 | 0,03 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | | |
| 0,237 % fällig am 21.11.2020 | € | 2.900 | | 2.912 | 0,41 |
| 0,787 % fällig am 21.11.2022 | | 800 | | 816 | 0,11 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 01.07.2019 | | 200 | | 200 | 0,03 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 24.07.2019 | | 1.000 | | 1.000 | 0,14 |
| **thyssenkrupp AG** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.10.2019 | | 2.360 | | 2.368 | 0,33 |
| **Total Capital International S.A.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 19.03.2020 | | 3.900 | | 3.908 | 0,55 |
| **Toyota Finance Australia Ltd.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 09.04.2021 (a) | | 1.500 | | 1.504 | 0,21 |
| **Toyota Motor Finance Netherlands BV** | | | | | |
| 0,038 % fällig am 27.04.2020 | | 3.700 | | 3.704 | 0,52 |
| **UCB S.A.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 04.01.2021 | | 900 | | 955 | 0,13 |
| **United Technologies Corp.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.05.2020 | | 5.500 | | 5.507 | 0,77 |
| **Vilmorin & Cie S.A.** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 26.05.2021 | | 1.600 | | 1.650 | 0,23 |
| **Volvo Treasury AB** | | | | | |
| 0,148 % fällig am 06.09.2019 | | 9.700 | | 9.707 | 1,36 |
| | | | | 153.376 | 21,52 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 03.08.2020 | | 7.700 | | 7.719 | 1,08 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 10.03.2021 | | 4.800 | | 4.860 | 0,68 |
| **British Transco International Finance BV** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.11.2021 (a) | $ | 100 | | 83 | 0,01 |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** | | | | | |
| 2,701 % fällig am 16.03.2020 | | 200 | | 176 | 0,03 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | | |
| 2,850 % fällig am 25.10.2019 | CHF | 3.400 | | 3.089 | 0,44 |
| 3,389 % fällig am 20.03.2020 | € | 800 | | 819 | 0,12 |
| **Orange S.A.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 09.04.2020 | | 300 | | 309 | 0,04 |
| **Rosneft Finance S.A.** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 02.02.2020 | $ | 5.000 | | 4.503 | 0,63 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 17.10.2020 | € | 1.100 | | 1.137 | 0,16 |
| | | | | 22.695 | 3,19 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | | 451.412 | 63,34 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Arena NHG BV** | | | | | |
| 0,012 % fällig am 17.06.2048 | | 2.638 | | 2.648 | 0,37 |
| **Bluestep Mortgage Securities DAC** | | | | | |
| 0,412 % fällig am 10.08.2066 | | 2.111 | | 2.113 | 0,30 |
| 1,453 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 2.327 | | 221 | 0,03 |
| **Brunel Residential Mortgage Securitisation PLC** | | | | | |
| 1,041 % fällig am 13.01.2039 | £ | 179 | | 197 | 0,03 |
| **Dolphin Master Issuer BV** | | | | | |
| 0,061 % fällig am 28.09.2099 | € | 8.500 | | 8.506 | 1,19 |
| **Duncan Funding PLC** | | | | | |
| 0,090 % fällig am 17.04.2063 | | 358 | | 358 | 0,05 |
| **Eurosail PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | | 469 | | 460 | 0,06 |
| **FT RMBS Prado** | | | | | |
| 0,582 % fällig am 17.03.2056 | | 3.555 | | 3.585 | 0,50 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | | |
| 0,139 % fällig am 24.07.2058 | | 572 | | 573 | 0,08 |
| **Grecale ABS SRL** | | | | | |
| 0,070 % fällig am 28.04.2056 | | 475 | | 474 | 0,07 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | | |
| 2,195 % fällig am 25.05.2053 | £ | 2.583 | | 2.892 | 0,41 |
| **Mulcair Securities DAC** | | | | | |
| 0,695 % fällig am 24.04.2071 | € | 500 | | 501 | 0,07 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 1,936 % fällig am 15.06.2046 | £ | 451 | € | 506 | 0,07 |
| **SapphireOne Mortgages FCT** | | | | | |
| 0,156 % fällig am 27.06.2061 | € | 1.944 | | 1.955 | 0,27 |
| 0,189 % fällig am 25.02.2061 | | 6.224 | | 6.228 | 0,87 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.01.2070 | | 5.038 | | 5.042 | 0,71 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 6.700 | | 7.516 | 1,05 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,775 % fällig am 21.09.2049 | | 158 | | 178 | 0,03 |
| 2,275 % fällig am 21.09.2049 | | 324 | | 364 | 0,05 |
| | | | | 44.317 | 6,21 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Alba SPV SRL** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 27.03.2038 | € | 677 | | 677 | 0,10 |
| **Asset-Backed European Securitisation Transaction** | | | | | |
| 0,004 % fällig am 23.08.2030 | | 1.534 | | 1.540 | 0,22 |
| **Auto ABS French Leases** | | | | | |
| 0,192 % fällig am 28.05.2030 | | 6.400 | | 6.429 | 0,90 |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | | |
| 0,009 % fällig am 22.04.2025 | | 4.005 | | 4.010 | 0,56 |
| 0,012 % fällig am 20.05.2024 | | 618 | | 618 | 0,09 |
| 0,012 % fällig am 20.10.2024 | | 4.025 | | 4.033 | 0,57 |
| 0,024 % fällig am 15.07.2026 | | 3.000 | | 3.001 | 0,42 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | | | |
| 0,850 % fällig am 15.04.2027 | | 1.798 | | 1.797 | 0,25 |
| **Bumper NL Finance BV** | | | | | |
| 0,004 % fällig am 22.07.2031 | | 7.542 | | 7.555 | 1,06 |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | | |
| 1,254 % fällig am 20.11.2027 | £ | 129 | | 144 | 0,02 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,730 % fällig am 21.09.2029 | € | 200 | | 200 | 0,03 |
| **Cars Alliance Auto Loans France** | | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.10.2029 | | 12.600 | | 12.635 | 1,77 |
| **Driver Australia Trust** | | | | | |
| 2,810 % fällig am 21.07.2026 | AUD | 643 | | 396 | 0,06 |
| **Driver Espana ET** | | | | | |
| 0,011 % fällig am 21.04.2028 | € | 6.058 | | 6.081 | 0,85 |
| **Driver Italia One SRL** | | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.04.2029 | | 2.807 | | 2.800 | 0,39 |
| **FACT Master S.A.** | | | | | |
| 0,109 % fällig am 20.11.2025 | | 5.969 | | 5.990 | 0,84 |
| **FCT Ginkgo Compartment Personal Loans** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.01.2039 | | 22 | | 22 | 0,00 |
| **FCT Titrisocram** | | | | | |
| 0,082 % fällig am 25.11.2035 | | 115 | | 115 | 0,02 |
| 0,082 % fällig am 25.07.2036 | | 6.752 | | 6.772 | 0,95 |
| **Flexi ABS Trust** | | | | | |
| 2,275 % fällig am 23.06.2023 | AUD | 269 | | 166 | 0,02 |
| **Globaldrive Auto Receivables BV** | | | | | |
| 0,009 % fällig am 20.08.2025 | € | 474 | | 476 | 0,07 |
| 0,109 % fällig am 20.08.2024 | | 455 | | 456 | 0,06 |
| **Purple Master Credit Cards** | | | | | |
| 0,052 % fällig am 25.10.2030 | | 2.600 | | 2.611 | 0,37 |
| **Red & Black Auto Germany UG** | | | | | |
| 0,124 % fällig am 15.09.2025 | | 1.791 | | 1.796 | 0,25 |
| **Red & Black Auto Lease Germany S.A.** | | | | | |
| 0,024 % fällig am 15.11.2027 | | 924 | | 925 | 0,13 |
| **SC Germany Auto UG** | | | | | |
| 0,023 % fällig am 13.12.2026 | | 1.585 | | 1.589 | 0,22 |
| **SCF Rahoituspalvelut Kimi DAC** | | | | | |
| 0,002 % fällig am 25.11.2026 | | 2.023 | | 2.027 | 0,29 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | | | |
| 0,074 % fällig am 17.03.2025 | | 4.210 | | 4.220 | 0,59 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2023 | | 25 | | 25 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 25.01.2024 | | 184 | | 184 | 0,03 |
| 0,000 % fällig am 17.06.2024 | | 159 | | 159 | 0,02 |
| **Sorrento Park CLO DAC** | | | | | |
| 0,639 % fällig am 16.11.2027 | | 1.789 | | 1.791 | 0,25 |
| **VCL Multi-Compartment S.A.** | | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.09.2023 | | 1.863 | | 1.866 | 0,26 |
| 0,009 % fällig am 21.01.2025 | | 371 | | 372 | 0,05 |
| **Wizink Master Credit Cards FT** | | | | | |
| 0,057 % fällig am 26.12.2031 | € | 2.100 | € | 2.103 | 0,30 |
| | | | | 85.581 | 12,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | | 1.500 | | 1.623 | 0,23 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 8.100 | | 8.331 | 1,17 |
| **Deposit Insurance Corp. of Japan** | | | | | |
| 0,100 % fällig am 17.01.2020 | ¥ | 800.000 | | 6.526 | 0,91 |
| **Export-Import Bank of China** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 02.12.2019 | € | 200 | | 200 | 0,03 |
| **Serbia Government International Bond** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 25.02.2020 | $ | 789 | | 702 | 0,10 |
| | | | | 17.382 | 2,44 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | | |
| **Campbell Soup Co.** | | | | | |
| 3,100 % fällig am 15.08.2019 | | 400 | | 350 | 0,05 |
| **Coral Capital Ltd.** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 05.07.2019 | € | 8.000 | | 8.001 | 1,12 |
| 1,000 % fällig am 18.07.2019 | | 5.000 | | 5.002 | 0,70 |
| **Enable Midstream Partners LP** | | | | | |
| 3,150 % fällig am 25.07.2019 | $ | 300 | | 263 | 0,04 |
| **Encana Corp.** | | | | | |
| 3,120 % fällig am 02.07.2019 | | 300 | | 263 | 0,04 |
| 3,200 % fällig am 01.08.2019 | | 700 | | 613 | 0,09 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | | |
| 3,030 % fällig am 02.07.2019 | | 1.100 | | 966 | 0,14 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 12.08.2019 | € | 3.500 | | 3.502 | 0,49 |
| **Heineken NV** | | | | | |
| 0,010 % fällig am 04.07.2019 | | 4.000 | | 4.000 | 0,56 |
| **Pure Finance S.A.** | | | | | |
| 0,122 % fällig am 12.12.2019 | | 100 | | 100 | 0,01 |
| **RELX investments PLC** | | | | | |
| 0,010 % fällig am 16.08.2019 | | 4.700 | | 4.703 | 0,66 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 0,081 % fällig am 19.08.2019 | | 2.000 | | 2.001 | 0,28 |
| 0,091 % fällig am 19.08.2019 | | 3.500 | | 3.503 | 0,49 |
| **Teleperformance** | | | | | |
| 0,010 % fällig am 13.09.2019 | | 3.200 | | 3.204 | 0,45 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 09.07.2019 | | 2.600 | | 2.600 | 0,37 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 28.08.2019 | | 7.000 | | 7.005 | 0,98 |
| **Weinberg Capital Ltd.** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.08.2019 | | 5.000 | | 5.002 | 0,70 |
| | | | | 51.078 | 7,17 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (e)** | | | | | |
| | | | | 54.412 | 7,63 |
| **FRANCE TREASURY BILLS** | | | | | |
| (0,565) % fällig am 18.09.2019 (a)(b) | | 2.890 | | 2.894 | 0,41 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | | 108.384 | 15,21 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **€** | **707.076** | **99,21** |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Euro Short-Term Fund (Forts.)

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Long | 12/2021 | 316 | € 83 | 0,01 |
| 90-Day Eurodollar September Futures | Long | 09/2022 | 384 | (28) | 0,00 |
| | | | | € 55 | 0,01 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **€ 55** | **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 | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,490 % | 20.07.2068 | € 4.100 | € 1.711 | 0,24 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,510 | 20.07.2068 | 4.100 | (1.718) | (0,24) |
| | | | | | € (7) | 0,00 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **€ (7)** | **0,00** |

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

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.09.2019 | $ 4.300 | € 6 | € 0 | € 6 | 0,00 |

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

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

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 4.612 | £ | 4.107 | € 0 | € (22) | € (22) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.454 | HUF | 1.771.470 | 0 | (175) | (175) | (0,03) |
| | 08/2019 | | 2.951 | RUB | 193.890 | 90 | 0 | 90 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | € | 26.534 | £ | 23.745 | 5 | (2) | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | SEK | 48.250 | € | 4.546 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 1.694 | $ | 286 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.383 | € | 1.224 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 23.104 | | 25.790 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2 | MXN | 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 39 | $ | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | € | 41.894 | | 47.613 | 0 | (84) | (84) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 47.734 | € | 41.894 | 85 | 0 | 85 | 0,01 |
| | 10/2019 | | 2 | MXN | 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 6.917 | $ | 7.807 | 0 | (62) | (62) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | HUF | 1.736.969 | | 6.311 | 156 | 0 | 156 | 0,02 |
| | 07/2019 | $ | 1.649 | € | 1.461 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 779 | | 479 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 10/2019 | DKK | 33.425 | | 4.483 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 04/2020 | | 18.380 | | 2.468 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 2.945 | SEK | 31.054 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 08/2019 | CHF | 3.794 | € | 3.354 | 0 | (65) | (65) | (0,01) |
| | 08/2019 | ¥ | 817.200 | | 6.654 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 31.054 | | 2.944 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 01/2020 | DKK | 65.611 | | 8.809 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ | 51.992 | | 46.496 | 840 | 0 | 840 | 0,12 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| UAG | 07/2019 | € 1.015 | £ 910 | € 2 | € 0 | € 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ 28.410 | € 32.161 | 411 | 0 | 411 | 0,06 |
| | | | | € 1.629 | € (452) | € 1.177 | 0,16 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **€ 1.183** | **0,16** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **€ 708.307** | **99,38** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **€ 4.394** | **0,62** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **€ 712.701** | **100,00** |

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

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

**(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.**

**Barmittel in Höhe von EUR 1.600 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von EUR 230 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(e) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 2.405 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | € (2.155) | € 2.112 | € 2.112 | 0,30 |
| IND | (0,460) | 28.06.2019 | 01.07.2019 | € 41.000 | Santander UK PLC 1,625 % fällig am 26.11.2020 | (40.916) | 41.000 | 40.998 | 5,74 |
| RYL | (0,500) | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 11.300 | Republic of Germany 6,500 % fällig am 04.07.2027 | (11.350) | 11.300 | 11.300 | 1,59 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **€ (54.421)** | **€ 54.412** | **€ 54.410** | **7,63** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 707.076 | € 0 | € 707.076 |
| Finanzderivate[3] | 55 | 1.176 | 0 | 1.231 |
| **Summen** | **€ 55** | **€ 708.252** | **€ 0** | **€ 708.307** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 0 | € 769.806 | € 8.539 | € 778.345 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (1.176) | 0 | (1.176) |
| **Summen** | **€ 0** | **€ 768.630** | **€ 8.539** | **€ 777.169** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | € (107) | € 230 | € 123 |
| BPS | (19) | 0 | (19) |
| CBK | 1 | 0 | 1 |
| GLM | (62) | 0 | (62) |
| HUS | 6 | 0 | 6 |
| JPM | 169 | (270) | (101) |
| MYI | 3 | 0 | 3 |
| SCX | (61) | 0 | (61) |
| TOR | 840 | (861) | (121) |
| UAG | 413 | (320) | 93 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 90,78 | 92,38 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 0,80 | 2,98 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 7,63 | 5,07 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,01 | 0,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,16 | (0,15) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 63,34 | 69,66 |
| Non-Agency-MBS | 6,21 | 6,07 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 12,01 | 14,30 |
| Staatsemissionen | 2,44 | 1,73 |
| Kurzfristige Instrumente | 15,21 | 8,67 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,01 | 0,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Devisenterminkontrakte | 0,16 | (0,15) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,62 | (0,28) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | € | 100 | $ 89 | 0,01 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | ARS | 3.880 | 79 | 0,01 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 18.520 | 427 | 0,05 |
| Summe Argentinien | | | 595 | 0,07 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Driver Australia Four Trust** | | | | |
| 2,185 % fällig am 21.08.2025 | AUD | 362 | 254 | 0,03 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Volkswagen Financial Services Australia Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 22.06.2020 | | 2.200 | 1.560 | 0,20 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,511 % fällig am 16.09.2059 | | 1.505 | 1.053 | 0,13 |
| Summe Australien | | | 2.867 | 0,36 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (f)(h) | € | 800 | 894 | 0,11 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.07.2019 (d)(f) | $ | 254 | 2 | 0,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 442 | 475 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | | 800 | 878 | 0,11 |
| 7,250 % fällig am 17.03.2044 | | 1.700 | 1.906 | 0,24 |
| 7,375 % fällig am 17.01.2027 | | 3.100 | 3.553 | 0,44 |
| **Swiss Insured Brazil Power Finance SARL** | | | | |
| 9,850 % fällig am 16.07.2032 | BRL | 13.000 | 3.714 | 0,46 |
| Summe Brasilien | | | 10.528 | 1,31 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.07.2031 | $ | 487 | 493 | 0,06 |
| **Canadian Imperial Bank of Commerce** | | | | |
| 3,150 % fällig am 27.06.2021 | | 1.000 | 1.020 | 0,13 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 3,110 % fällig am 15.06.2020 | | 600 | 602 | 0,07 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 900 | 1.100 | 0,14 |
| **HSBC Bank Canada** | | | | |
| 3,300 % fällig am 28.11.2021 | $ | 1.700 | 1.751 | 0,22 |
| | | | 4.966 | 0,62 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 2,078 % fällig am 01.06.2020 | CAD | 447 | 342 | 0,05 |
| 2,278 % fällig am 01.07.2020 | | 1.271 | 974 | 0,12 |
| 2,278 % fällig am 01.08.2020 | | 443 | 339 | 0,04 |
| **Real Estate Asset Liquidity Trust** | | | | |
| 3,072 % fällig am 12.08.2053 | | 629 | 490 | 0,06 |
| | | | 2.145 | 0,27 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 | | 3.647 | 3.581 | 0,44 |
| Summe Kanada | | | 10.692 | 1,33 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Evans Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 3,441 % fällig am 28.05.2028 | $ | 500 | $ 497 | 0,06 |
| **Figueroa CLO Ltd.** | | | | |
| 3,237 % fällig am 20.06.2027 | | 1.900 | 1.895 | 0,24 |
| 3,497 % fällig am 15.01.2027 | | 1.832 | 1.831 | 0,23 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | |
| 3,642 % fällig am 21.01.2028 | | 1.000 | 999 | 0,12 |
| **Jamestown CLO Ltd.** | | | | |
| 3,808 % fällig am 17.01.2027 | | 3.298 | 3.302 | 0,41 |
| **Loomis Sayles CLO Ltd.** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.04.2028 | | 2.000 | 1.990 | 0,25 |
| **Mountain View CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.10.2026 | | 368 | 366 | 0,04 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 3,633 % fällig am 30.04.2027 | | 1.800 | 1.799 | 0,22 |
| **Sound Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,482 % fällig am 20.01.2028 | | 1.900 | 1.898 | 0,24 |
| **Staniford Street CLO Ltd.** | | | | |
| 3,590 % fällig am 15.06.2025 | | 713 | 715 | 0,09 |
| **Symphony CLO Ltd.** | | | | |
| 3,627 % fällig am 15.10.2025 | | 3.096 | 3.098 | 0,39 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 3,667 % fällig am 15.04.2027 | | 400 | 399 | 0,05 |
| **WhiteHorse Ltd.** | | | | |
| 3,518 % fällig am 17.04.2027 | | 400 | 399 | 0,05 |
| | | | 19.188 | 2,39 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 | | 426 | 411 | 0,05 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % bar und 1,000 % PIK)** | | | | |
| 7,720 % fällig am 01.12.2026 (c) | | 1.746 | 446 | 0,06 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 29.04.2020 | | 150 | 150 | 0,02 |
| 3,576 % fällig am 02.05.2022 | | 1.800 | 1.813 | 0,23 |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 3.600 | 3.609 | 0,45 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 3.700 | 3.709 | 0,46 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | | 200 | 211 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 400 | 430 | 0,05 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 600 | 653 | 0,08 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 300 | 307 | 0,04 |
| | | | 11.739 | 1,47 |
| Summe Cayman Inseln | | | 30.927 | 3,86 |
| **CHINA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **China Development Bank** | | | | |
| 3,050 % fällig am 25.08.2026 | CNY | 5.200 | 723 | 0,09 |
| 3,680 % fällig am 26.02.2026 | | 20.700 | 3.003 | 0,37 |
| 4,040 % fällig am 10.04.2027 | | 9.100 | 1.343 | 0,17 |
| 4,150 % fällig am 26.10.2025 | | 2.500 | 372 | 0,05 |
| 4,240 % fällig am 24.08.2027 | | 15.800 | 2.365 | 0,30 |
| **China Government International Bond** | | | | |
| 2,740 % fällig am 04.08.2026 | | 800 | 112 | 0,01 |
| Summe China | | | 7.918 | 0,99 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ecopetrol S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 28.05.2045 | $ | 2.000 | 2.219 | 0,28 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Colombian TES** | | | | |
| 6,000 % fällig am 28.04.2028 | COP | 280.000 | 714 | 0,09 |
| Summe Kolumbien | | | 2.933 | 0,37 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **TSCHECHISCHE REPUBLIK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Czech Republic Government International Bond** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.05.2030 | CZK | 12.100 | $ 509 | 0,06 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 5.514 | 873 | 0,11 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 20.000 | 3.115 | 0,39 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 8.132 | 1.282 | 0,16 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 3.039 | 481 | 0,06 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 12.300 | 1.906 | 0,24 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 16.919 | 2.665 | 0,33 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 19.280 | 3.040 | 0,38 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 31 | 5 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 3.286 | 520 | 0,06 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 55.600 | 8.653 | 1,08 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 30.106 | 4.750 | 0,59 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 384 | 62 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 51 | 8 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 34 | 6 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 54.022 | 8.515 | 1,06 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2036 | | 316 | 51 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | | 70 | 11 | 0,00 |
| Summe Dänemark | | | 35.943 | 4,48 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Purple Master Credit Cards** | | | | |
| 0,052 % fällig am 25.10.2030 | € | 2.000 | 2.287 | 0,28 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 23.01.2026 | £ | 1.100 | 1.488 | 0,19 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 24.04.2023 | $ | 1.100 | 1.142 | 0,14 |
| **Danone S.A.** | | | | |
| 2,077 % fällig am 02.11.2021 | | 1.300 | 1.292 | 0,16 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 17.01.2025 | € | 900 | 1.062 | 0,13 |
| 2,250 % fällig am 18.02.2020 | $ | 800 | 800 | 0,10 |
| 2,375 % fällig am 20.09.2022 | | 3.600 | 3.638 | 0,45 |
| **Teleperformance** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.07.2025 | € | 300 | 360 | 0,05 |
| | | | 9.782 | 1,22 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 (e)(i) | | 5.101 | 6.274 | 0,78 |
| 2,000 % fällig am 25.05.2048 (i) | | 1.100 | 1.613 | 0,20 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 | | 200 | 360 | 0,05 |
| | | | 8.247 | 1,03 |
| Summe Frankreich | | | 20.316 | 2,53 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Driver Multi-Compartment S.A.** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.02.2026 | | 562 | 641 | 0,08 |
| **Red & Black Auto Germany UG** | | | | |
| 0,124 % fällig am 15.09.2025 | | 722 | 824 | 0,10 |
| | | | 1.465 | 0,18 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aareal Bank AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 15.09.2020 | $ | 2.300 | 2.291 | 0,29 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 500 | 574 | 0,07 |
| 3,407 % fällig am 22.01.2021 | $ | 1.900 | 1.875 | 0,23 |
| 3,855 % fällig am 04.02.2021 | | 600 | 595 | 0,08 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 3.400 | 3.448 | 0,43 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Deutsche Pfandbriefbank AG** | | | | |
| 2,500 % fällig am 31.05.2022 | $ | 3.400 | $ 3.442 | 0,43 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c) | € | 700 | 817 | 0,10 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (c) | | 700 | 811 | 0,10 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.04.2024 (d) | | 2.500 | 2.908 | 0,36 |
| 5,000 % fällig am 19.03.2024 | AUD | 100 | 82 | 0,01 |
| **Landwirtschaftliche Rentenbank** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.01.2023 | | 400 | 309 | 0,04 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.08.2022 | € | 200 | 234 | 0,03 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,625 % fällig am 01.04.2022 | | 900 | 1.035 | 0,13 |
| | | | 18.421 | 2,30 |
| Summe Deutschland | | | 19.886 | 2,48 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 09.06.2023 | $ | 1.600 | 1.660 | 0,21 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AIA Group Ltd.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 06.04.2028 | | 500 | 532 | 0,07 |
| **Eastern Creation Investment Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.09.2020 | | 800 | 801 | 0,10 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | | |
| 3,510 % fällig am 28.06.2021 | | 700 | 703 | 0,09 |
| **ICBCIL Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 29.09.2019 | | 1.100 | 1.099 | 0,14 |
| **Poly Real Estate Finance Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 05.02.2023 | | 500 | 508 | 0,06 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 4,071 % fällig am 25.05.2023 | | 500 | 500 | 0,06 |
| Summe Hongkong | | | 4.143 | 0,52 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ICICI Bank Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 18.03.2020 | | 3.800 | 3.817 | 0,48 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,835 % fällig am 13.12.2027 | | 500 | 509 | 0,06 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,700 % fällig am 27.02.2022 | | 1.800 | 1.827 | 0,23 |
| Summe Indien | | | 6.153 | 0,77 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Indonesia Asahan Aluminium Persero PT** | | | | |
| 5,230 % fällig am 15.11.2021 | | 400 | 422 | 0,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 2,625 % fällig am 14.06.2023 | € | 10.700 | 13.207 | 1,65 |
| 4,100 % fällig am 24.04.2028 | $ | 5.600 | 5.921 | 0,74 |
| 5,250 % fällig am 17.01.2042 | | 500 | 571 | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 15.01.2044 | | 200 | 274 | 0,03 |
| 8,250 % fällig am 15.05.2036 | IDR | 43.550.000 | 3.225 | 0,40 |
| 8,375 % fällig am 15.03.2034 | | 101.128.000 | 7.605 | 0,95 |
| | | | 30.803 | 3,84 |
| Summe Indonesien | | | 31.225 | 3,90 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,680 % fällig am 13.10.2029 | € | 1.000 | 1.136 | 0,14 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,870 % fällig am 18.01.2030 | | 1.700 | 1.936 | 0,24 |
| **Dorchester Park CLO DAC** | | | | |
| 3,492 % fällig am 20.04.2028 | $ | 1.900 | $ 1.888 | 0,24 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 2.000 | 2.278 | 0,28 |
| **Sorrento Park CLO DAC** | | | | |
| 0,639 % fällig am 16.11.2027 | | 1.257 | 1.433 | 0,18 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 15.10.2030 | | 1.800 | 2.055 | 0,26 |
| | | | 10.726 | 1,34 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | $ | 1.100 | 1.128 | 0,14 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.10.2023 | | 300 | 316 | 0,04 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (f)(h) | € | 300 | 361 | 0,05 |
| **Shire Acquisitions Investments Ireland DAC** | | | | |
| 1,900 % fällig am 23.09.2019 | $ | 1.300 | 1.298 | 0,16 |
| 2,400 % fällig am 23.09.2021 | | 400 | 400 | 0,05 |
| | | | 3.503 | 0,44 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (g)** | | 26.940 | 2.734 | 0,34 |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g) | | 446.527 | 5.198 | 0,65 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Bluestep Mortgage Securities DAC** | | | | |
| 1,453 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 3.491 | 378 | 0,05 |
| Summe Irland | | | 22.539 | 2,82 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 31.08.2025 | ILS | 3.700 | 1.077 | 0,14 |
| 3,250 % fällig am 17.01.2028 | $ | 700 | 741 | 0,09 |
| 4,125 % fällig am 17.01.2048 | | 600 | 658 | 0,08 |
| Summe Israel | | | 2.476 | 0,31 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banca Carige SpA** | | | | |
| 1,090 % fällig am 25.02.2021 | € | 2.600 | 2.973 | 0,37 |
| 1,389 % fällig am 25.10.2021 | | 800 | 921 | 0,11 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h) | | 600 | 722 | 0,09 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 1.600 | 1.829 | 0,23 |
| | | | 6.445 | 0,80 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,450 % fällig am 15.11.2024 (i) | € | 13.200 | 15.098 | 1,88 |
| 2,100 % fällig am 15.07.2026 | | 3.500 | 4.099 | 0,51 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (i) | | 6.203 | 7.617 | 0,95 |
| 2,450 % fällig am 01.10.2023 (i) | | 4.600 | 5.523 | 0,69 |
| 2,500 % fällig am 15.11.2025 (i) | | 2.500 | 3.009 | 0,38 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2029 | | 5.000 | 6.176 | 0,77 |
| **Italy Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 | £ | 1.000 | 1.499 | 0,19 |
| | | | 43.021 | 5,37 |
| Summe Italien | | | 49.466 | 6,17 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 2,362 % fällig am 28.05.2021 | $ | 1.000 | $ 999 | 0,13 |
| 2,567 % fällig am 02.11.2021 | | 3.200 | 3.212 | 0,40 |
| 2,978 % fällig am 15.02.2022 | | 1.000 | 998 | 0,12 |
| **Japan Tobacco, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 13.04.2021 | | 300 | 297 | 0,04 |
| **Meiji Yasuda Life Insurance Co.** | | | | |
| 5,100 % fällig am 26.04.2048 | | 300 | 327 | 0,04 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.03.2021 | | 403 | 407 | 0,05 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,331 % fällig am 11.09.2022 | | 2.100 | 2.113 | 0,26 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 2,860 % fällig am 29.06.2020 | | 300 | 301 | 0,04 |
| **ORIX Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 04.12.2024 | | 300 | 310 | 0,04 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,550 % fällig am 06.11.2023 | € | 2.200 | 2.575 | 0,32 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,934 % fällig am 09.03.2021 | $ | 1.900 | 1.918 | 0,24 |
| 4,133 % fällig am 09.03.2021 | | 900 | 919 | 0,12 |
| | | | 14.376 | 1,80 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Bank for International Cooperation** | | | | |
| 3,250 % fällig am 20.07.2023 | | 900 | 941 | 0,12 |
| 3,375 % fällig am 31.10.2023 | | 600 | 632 | 0,08 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.03.2024 | | 200 | 207 | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 27.09.2023 | | 1.400 | 1.462 | 0,18 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2026 | ¥ | 2.174.411 | 20.959 | 2,61 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 | | 727.150 | 7.049 | 0,88 |
| 0,500 % fällig am 20.09.2046 | | 403.000 | 3.904 | 0,49 |
| 0,500 % fällig am 20.03.2049 | | 578.000 | 5.574 | 0,69 |
| 0,700 % fällig am 20.12.2048 | | 636.000 | 6.464 | 0,81 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.05.2021 | $ | 1.100 | 1.096 | 0,14 |
| 2,500 % fällig am 08.06.2022 | | 3.000 | 3.032 | 0,38 |
| 2,625 % fällig am 29.05.2024 | | 400 | 409 | 0,05 |
| | | | 51.729 | 6,45 |
| Summe Japan | | | 66.105 | 8,25 |
| **KUWAIT** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kuwait International Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.03.2022 | | 400 | 406 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2027 | | 9.700 | 10.342 | 1,29 |
| Summe Kuwait | | | 10.748 | 1,34 |
| **LITAUEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Lithuania Government International Bond** | | | | |
| 6,125 % fällig am 09.03.2021 | | 1.200 | 1.276 | 0,16 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | |
| 0,012 % fällig am 20.05.2024 | € | 216 | 247 | 0,03 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | | |
| 0,074 % fällig am 17.03.2025 | | 535 | 610 | 0,08 |
| | | | 857 | 0,11 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 | $ | 200 | 204 | 0,03 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.11.2026 | € | 500 | 599 | 0,07 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 1.000 | 1.036 | 0,13 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (d) | € | 840 | 927 | 0,12 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.04.2021 | € | 1.400 | $ 1.608 | 0,20 |
| **NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank** | | | | |
| 2,875 % fällig am 16.02.2021 | $ | 1.400 | 1.416 | 0,18 |
| **SELP Finance SARL** | | | | |
| 1,250 % fällig am 25.10.2023 | € | 1.400 | 1.645 | 0,20 |
| **Unigel Luxembourg S.A.** | | | | |
| 10,500 % fällig am 22.01.2024 | $ | 2.200 | 2.365 | 0,29 |
| | | | 9.800 | 1,22 |
| Summe Luxemburg | | | 10.657 | 1,33 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Malaysia Government International Bond** | | | | |
| 4,232 % fällig am 30.06.2031 | MYR | 3.600 | 907 | 0,11 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 2.400 | 2.781 | 0,35 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Preferred Term Securities Ltd.** | | | | |
| 2,810 % fällig am 23.06.2035 | $ | 1.875 | 1.800 | 0,22 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accunia European CLO BV** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 600 | 685 | 0,09 |
| **Babson Euro CLO BV** | | | | |
| 0,509 % fällig am 25.10.2029 | | 1.600 | 1.815 | 0,23 |
| **Barings Euro CLO BV** | | | | |
| 0,680 % fällig am 27.07.2030 | | 900 | 1.022 | 0,13 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | | |
| 0,880 % fällig am 15.01.2030 | | 1.700 | 1.938 | 0,24 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | |
| 0,530 % fällig am 12.07.2028 | | 1.300 | 1.480 | 0,18 |
| | | | 6.940 | 0,87 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 2,450 % fällig am 04.06.2020 | $ | 900 | 901 | 0,11 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (f)(h) | € | 600 | 758 | 0,10 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 (h) | | 1.500 | 1.793 | 0,23 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | $ | 14.700 | 14.997 | 1,87 |
| **JT International Financial Services BV** | | | | |
| 2,750 % fällig am 28.09.2033 | £ | 200 | 263 | 0,03 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (f) | € | 300 | 419 | 0,05 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | $ | 400 | 416 | 0,05 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.04.2022 | € | 300 | 338 | 0,04 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 1,239 % fällig am 16.11.2024 | | 1.400 | 1.628 | 0,20 |
| | | | 21.513 | 2,68 |
| Summe Niederlande | | | 28.453 | 3,55 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DNB Boligkreditt A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 28.03.2022 | $ | 1.900 | 1.924 | 0,24 |
| 3,250 % fällig am 28.06.2023 | | 1.100 | 1.149 | 0,14 |
| | | | 3.073 | 0,38 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Norway Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.03.2025 | NOK | 6.000 | 722 | 0,09 |
| 3,750 % fällig am 25.05.2021 | NOK | 3.700 | $ 454 | 0,06 |
| | | | 1.176 | 0,15 |
| Summe Norwegen | | | 4.249 | 0,53 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 28.600 | 9.493 | 1,18 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 1.200 | 401 | 0,05 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 16.900 | 5.774 | 0,72 |
| Summe Peru | | | 15.668 | 1,95 |
| **PHILIPPINES** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Philippines Government International Bond** | | | | |
| 6,250 % fällig am 14.01.2036 | PHP | 38.000 | 852 | 0,11 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^ | € | 1.900 | 530 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | | 600 | 168 | 0,02 |
| Summe Portugal | | | 698 | 0,09 |
| **KATAR** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.03.2024 | $ | 1.300 | 1.345 | 0,17 |
| 4,000 % fällig am 14.03.2029 | | 1.200 | 1.295 | 0,16 |
| 4,500 % fällig am 20.01.2022 | | 5.800 | 6.101 | 0,76 |
| 4,817 % fällig am 14.03.2049 | | 500 | 574 | 0,07 |
| Summe Katar | | | 9.315 | 1,16 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 5,850 % fällig am 26.04.2023 | RON | 2.900 | 743 | 0,09 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 7,950 % fällig am 07.10.2026 | RUB | 1.139.700 | 18.754 | 2,34 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Saudi Arabian Oil Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 16.04.2022 | $ | 400 | 404 | 0,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 26.10.2021 | | 5.700 | 5.697 | 0,71 |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 8.400 | 8.510 | 1,06 |
| 3,250 % fällig am 26.10.2026 | | 1.200 | 1.226 | 0,15 |
| 3,625 % fällig am 04.03.2028 | | 1.300 | 1.338 | 0,17 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 2.000 | 2.132 | 0,27 |
| 4,375 % fällig am 16.04.2029 | | 1.300 | 1.407 | 0,17 |
| | | | 20.310 | 2,53 |
| Summe Saudi-Arabien | | | 20.714 | 2,58 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 1.200 | 1.199 | 0,15 |
| 3,500 % fällig am 18.09.2027 | | 400 | 399 | 0,05 |
| **DBS Bank Ltd.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 27.11.2021 | | 700 | 717 | 0,09 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | | |
| 2,975 % fällig am 17.05.2021 | | 1.000 | 1.001 | 0,13 |
| **PSA Treasury Pte. Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 12.04.2026 | | 2.300 | 2.275 | 0,28 |
| | | | 5.591 | 0,70 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Singapore Government International Bond** | | | | |
| 2,125 % fällig am 01.06.2026 | SGD | 2.800 | $ 2.101 | 0,26 |
| Summe Singapur | | | 7.692 | 0,96 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 1,188 % fällig am 14.03.2029 | € | 1.100 | 1.375 | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 1.089 | 1.226 | 0,15 |
| Summe Slowenien | | | 2.601 | 0,32 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 5,375 % fällig am 24.07.2044 | | 900 | 909 | 0,11 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.07.2023 | | 300 | 314 | 0,04 |
| **Korea Government International Bond** | | | | |
| 2,125 % fällig am 10.06.2027 | KRW | 680.000 | 613 | 0,07 |
| 2,375 % fällig am 10.12.2028 | | 1.360.000 | 1.259 | 0,16 |
| 2,625 % fällig am 10.06.2028 | | 1.360.000 | 1.279 | 0,16 |
| Summe Südkorea | | | 3.465 | 0,43 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (f)(h) | € | 800 | 959 | 0,12 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (f)(h) | | 600 | 703 | 0,09 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 4,379 % fällig am 12.04.2028 | $ | 400 | 426 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 19.03.2025 (f)(h) | € | 1.800 | 1.942 | 0,24 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (f)(h) | | 300 | 360 | 0,04 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | | 600 | 714 | 0,09 |
| | | | 5.104 | 0,63 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035 | | 300 | 411 | 0,05 |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | | 1.500 | 1.848 | 0,23 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 1.900 | 2.226 | 0,28 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 0,250 % fällig am 30.07.2024 | | 3.000 | 3.489 | 0,44 |
| 0,600 % fällig am 31.10.2029 | | 6.100 | 7.054 | 0,88 |
| 1,400 % fällig am 30.07.2028 | | 1.900 | 2.374 | 0,30 |
| 1,450 % fällig am 30.04.2029 | | 1.500 | 1.882 | 0,23 |
| 2,700 % fällig am 31.10.2048 | | 600 | 899 | 0,11 |
| | | | 20.183 | 2,52 |
| Summe Spanien | | | 25.287 | 3,15 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.01.2029 | | 500 | 605 | 0,08 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Landshypotek Bank AB** | | | | |
| 0,700 % fällig am 09.05.2022 | SEK | 37.000 | 4.062 | 0,51 |
| **Lansforsakringar Hypotek AB** | | | | |
| 1,250 % fällig am 20.09.2023 | | 8.900 | 1.005 | 0,13 |
| 2,250 % fällig am 21.09.2022 | | 26.600 | 3.075 | 0,38 |
| **Nordea Hypotek AB** | | | | |
| 1,000 % fällig am 08.04.2022 | | 42.400 | 4.703 | 0,59 |
| **PZU Finance AB** | | | | |
| 1,375 % fällig am 03.07.2019 | € | 3.300 | 3.758 | 0,47 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Skandinaviska Enskilda Banken AB** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.12.2021 | SEK | 42.500 | $ 4.760 | 0,59 |
| **Stadshypotek AB** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.12.2021 | | 12.000 | 1.344 | 0,17 |
| 4,500 % fällig am 21.09.2022 | | 37.000 | 4.567 | 0,57 |
| **Sveriges Sakerstallda Obligationer AB** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.06.2022 | | 24.000 | 2.685 | 0,34 |
| 2,000 % fällig am 17.06.2026 | | 3.000 | 356 | 0,04 |
| **Swedbank Hypotek AB** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.09.2021 | | 56.200 | 6.205 | 0,77 |
| Summe Schweden | | | 36.520 | 4,56 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | $ | 1.400 | 1.544 | 0,19 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,628 % fällig am 14.12.2023 | | 400 | 401 | 0,05 |
| **UBS AG** | | | | |
| 2,200 % fällig am 08.06.2020 | | 1.800 | 1.799 | 0,23 |
| 2,450 % fällig am 01.12.2020 | | 1.100 | 1.102 | 0,14 |
| 3,000 % fällig am 01.12.2020 | | 1.600 | 1.606 | 0,20 |
| Summe Schweiz | | | 6.452 | 0,81 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 7,250 % fällig am 23.12.2023 | | 1.800 | 1.864 | 0,23 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.03.2022 | | 2.500 | 2.527 | 0,31 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | | 3.800 | 3.833 | 0,48 |
| 3,125 % fällig am 11.10.2027 | | 5.100 | 5.300 | 0,66 |
| | | | 9.133 | 1,14 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | 11.660 | 1,45 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | |
| 1,310 % fällig am 20.09.2028 | £ | 1.500 | 1.912 | 0,24 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | $ | 8.000 | 8.741 | 1,09 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 3,200 % fällig am 10.08.2021 | | 400 | 403 | 0,05 |
| 4,655 % fällig am 10.08.2021 | | 1.900 | 1.942 | 0,24 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | € | 200 | 231 | 0,03 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | £ | 700 | 900 | 0,11 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (f)(h) | € | 600 | 741 | 0,09 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (f)(h) | $ | 500 | 525 | 0,07 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | | 500 | 501 | 0,06 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 0,869 % fällig am 13.09.2021 | € | 500 | 571 | 0,07 |
| 1,660 % fällig am 11.02.2021 | | 500 | 581 | 0,07 |
| **Frontier Finance PLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 23.03.2022 | £ | 2.300 | 3.058 | 0,38 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 12.08.2020 | $ | 1.600 | 1.632 | 0,20 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,120 % fällig am 18.05.2021 | | 900 | 901 | 0,11 |
| 3,520 % fällig am 18.05.2024 | | 800 | 803 | 0,10 |
| 4,750 % fällig am 04.07.2029 (f)(h) | € | 700 | 839 | 0,11 |
| 6,500 % fällig am 23.03.2028 (f)(h) | $ | 500 | 525 | 0,07 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | £ | 1.400 | 2.221 | 0,28 |
| 5,125 % fällig am 07.03.2025 | | 3.100 | 4.760 | 0,59 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (f)(h) | | 200 | 278 | 0,04 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.12.2023 | £ | 1.100 | $ 1.433 | 0,18 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | $ | 2.200 | 2.247 | 0,28 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.06.2022 | | 900 | 900 | 0,11 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | | 400 | 411 | 0,05 |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | | 2.600 | 2.596 | 0,32 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 800 | 834 | 0,10 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 900 | 977 | 0,12 |
| 6,400 % fällig am 21.10.2019 | | 200 | 202 | 0,03 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (f)(h) | | 600 | 617 | 0,08 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 05.08.2021 | | 3.800 | 3.807 | 0,48 |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | | 1.400 | 1.414 | 0,18 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (f)(h) | £ | 400 | 542 | 0,07 |
| **Tesco PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | | 50 | 71 | 0,01 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 586 | 986 | 0,12 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | | 1.100 | 1.445 | 0,18 |
| **Virgin Money PLC** | | | | |
| 1,417 % fällig am 22.03.2024 | | 800 | 1.025 | 0,13 |
| | | | 49.660 | 6,20 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Aggregator of Loans Backed by Assets PLC** | | | | |
| 1,972 % fällig am 24.04.2049 | | 1.105 | 1.411 | 0,18 |
| **Alba PLC** | | | | |
| 0,958 % fällig am 17.03.2039 | | 1.426 | 1.712 | 0,21 |
| **Dukinfield PLC** | | | | |
| 1,806 % fällig am 15.08.2045 | | 1.221 | 1.558 | 0,19 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | € | 144 | 162 | 0,02 |
| 0,939 % fällig am 13.03.2045 | £ | 740 | 919 | 0,12 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,743 % fällig am 12.09.2068 | | 2.806 | 3.581 | 0,45 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,911 % fällig am 18.03.2039 | | 84 | 105 | 0,01 |
| 0,921 % fällig am 18.06.2039 | | 646 | 803 | 0,10 |
| 2,532 % fällig am 18.06.2039 | $ | 441 | 429 | 0,05 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 2,195 % fällig am 25.05.2053 | £ | 1.098 | 1.400 | 0,18 |
| **Holmes Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,101 % fällig am 15.10.2054 | | 1.143 | 1.454 | 0,18 |
| **Lanark Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,619 % fällig am 22.12.2069 | | 1.500 | 1.916 | 0,24 |
| **Oncilla Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 2,193 % fällig am 12.12.2043 | | 1.607 | 2.061 | 0,26 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,760 % fällig am 15.05.2045 (b) | | 1.500 | 1.910 | 0,24 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,582 % fällig am 20.03.2050 | | 2.196 | 2.791 | 0,35 |
| 1,936 % fällig am 15.06.2046 | | 572 | 730 | 0,09 |
| **Resloc UK PLC** | | | | |
| 0,946 % fällig am 15.12.2043 | | 779 | 936 | 0,12 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | | 2.344 | 2.980 | 0,37 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,493 % fällig am 12.06.2046 | | 1.206 | 1.521 | 0,19 |
| 1,763 % fällig am 12.06.2046 | | 1.286 | 1.635 | 0,20 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 0,963 % fällig am 12.06.2044 | | 876 | 1.058 | 0,13 |
| **Rochester Financing PLC** | | | | |
| 2,081 % fällig am 18.06.2045 | | 1.115 | 1.426 | 0,18 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 2.400 | 3.066 | 0,38 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 0,986 % fällig am 10.06.2059 | | 349 | 425 | 0,05 |
| 1,136 % fällig am 10.06.2059 | | 85 | 102 | 0,01 |
| 1,336 % fällig am 10.06.2059 | | 66 | 80 | 0,01 |
| 1,536 % fällig am 10.06.2059 | | 71 | 85 | 0,01 |
| | | | 36.256 | 4,52 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | |
| 10,250 % | 2.630 | $ 507 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (i) | £ | 7.012 | 10.125 | 1,26 |
| Summe Großbritannien | | | 98.460 | 12,28 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.07.2036 | $ | 145 | 117 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.02.2036 | | 125 | 125 | 0,02 |
| 3,064 % fällig am 25.11.2035 | | 872 | 878 | 0,11 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,094 % fällig am 25.07.2035 | | 163 | 164 | 0,02 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,784 % fällig am 25.02.2036 | | 1.305 | 1.068 | 0,13 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 88 | 130 | 0,02 |
| 2,690 % fällig am 25.12.2036 | | 570 | 571 | 0,07 |
| 4,366 % fällig am 25.07.2036 | | 77 | 78 | 0,01 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.01.2037 | | 1.100 | 886 | 0,11 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.03.2036 | | 1.868 | 1.734 | 0,22 |
| 4,603 % fällig am 25.10.2037 | | 1.007 | 1.045 | 0,13 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,814 % fällig am 25.10.2035 | | 646 | 649 | 0,08 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,534 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 1.157 | 1.089 | 0,14 |
| 2,544 % fällig am 25.06.2037 | | 1.131 | 1.073 | 0,13 |
| 2,544 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 1.270 | 1.207 | 0,15 |
| 2,544 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 391 | 353 | 0,04 |
| 2,564 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 339 | 336 | 0,04 |
| 2,564 % fällig am 25.05.2036 | | 382 | 354 | 0,04 |
| 2,574 % fällig am 25.06.2047 | | 52 | 52 | 0,01 |
| 2,604 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 1.457 | 1.301 | 0,16 |
| 2,664 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 4.893 | 4.789 | 0,60 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.03.2037 | | 646 | 643 | 0,08 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.11.2035 | | 185 | 180 | 0,02 |
| **First NLC Trust** | | | | |
| 2,474 % fällig am 25.08.2037 | | 523 | 333 | 0,04 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.06.2035 | | 110 | 110 | 0,01 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.12.2046 | | 252 | 159 | 0,02 |
| 2,634 % fällig am 25.12.2046 | | 126 | 81 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.09.2036 | | 3.742 | 1.837 | 0,23 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 3,499 % fällig am 25.05.2035 | | 1.354 | 1.360 | 0,17 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 | | 237 | 96 | 0,01 |
| 2,814 % fällig am 25.01.2036 | | 2.300 | 2.231 | 0,28 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.04.2036 | | 220 | 219 | 0,03 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 3,204 % fällig am 25.10.2035 | | 365 | 364 | 0,05 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,049 % fällig am 25.11.2035 | | 316 | 315 | 0,04 |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 3,530 % fällig am 25.04.2038 | | 86 | 87 | 0,01 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.08.2036 | | 358 | 189 | 0,02 |
| 2,614 % fällig am 25.05.2037 | | 708 | 680 | 0,09 |
| 2,644 % fällig am 25.06.2036 | | 4.943 | 2.884 | 0,36 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,534 % fällig am 25.10.2036 | | 1.043 | 1.008 | 0,13 |
| 2,534 % fällig am 25.01.2037 | | 2.489 | 1.412 | 0,18 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | | 204 | 134 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | PAR (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| 2,644 % fällig am 25.06.2036 | $ 1.963 | $ 1.311 | 0,16 |
| 2,654 % fällig am 25.03.2037 | 416 | 230 | 0,03 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 3,124 % fällig am 25.03.2035 | 167 | 165 | 0,02 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | 258 | 142 | 0,02 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.03.2037 | 536 | 491 | 0,06 |
| **RAAC Trust** | | | |
| 3,904 % fällig am 25.09.2047 | 500 | 521 | 0,07 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | |
| 5,731 % fällig am 25.11.2036 | 2.861 | 1.582 | 0,20 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 2,724 % fällig am 25.01.2036 | 616 | 562 | 0,07 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | 176 | 175 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.04.2037 | 472 | 469 | 0,06 |
| 2,674 % fällig am 25.05.2037 | 85 | 85 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.04.2036 | 200 | 195 | 0,02 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 2,654 % fällig am 25.05.2036 | 545 | 357 | 0,04 |
| 2,674 % fällig am 25.03.2036 | 196 | 184 | 0,02 |
| 3,064 % fällig am 25.08.2035 ^ | 1.153 | 787 | 0,10 |
| 3,364 % fällig am 25.01.2036 ^ | 82 | 65 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 2,654 % fällig am 25.11.2036 | 1.900 | 1.792 | 0,22 |
| 2,684 % fällig am 25.05.2036 | 1.000 | 980 | 0,12 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | 120 | 116 | 0,01 |
| 2,714 % fällig am 25.01.2036 | 3.754 | 3.604 | 0,45 |
| 3,454 % fällig am 25.08.2033 | 26 | 26 | 0,00 |
| | | 46.160 | 5,76 |

**UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL**

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Aetna, Inc.** | | | |
| 2,800 % fällig am 15.06.2023 | 800 | 805 | 0,10 |
| **Air Lease Corp.** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.03.2021 | 400 | 400 | 0,05 |
| **Allergan Sales LLC** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2021 | 400 | 418 | 0,05 |
| **American Honda Finance Corp.** | | | |
| 2,915 % fällig am 05.11.2021 | 400 | 401 | 0,05 |
| **American Tower Corp.** | | | |
| 1,950 % fällig am 22.05.2026 | € 300 | 365 | 0,05 |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | $ 200 | 200 | 0,02 |
| 3,800 % fällig am 15.08.2029 | 1.300 | 1.343 | 0,17 |
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 1,800 % fällig am 05.09.2026 | € 1.700 | 2.099 | 0,26 |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | $ 4.300 | 4.323 | 0,54 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | 2.500 | 2.523 | 0,31 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | |
| 3,470 % fällig am 01.06.2021 | 2.600 | 2.614 | 0,33 |
| **AXA Equitable Holdings, Inc.** | | | |
| 3,900 % fällig am 20.04.2023 | 100 | 104 | 0,01 |
| 4,350 % fällig am 20.04.2028 | 300 | 316 | 0,04 |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 3,269 % fällig am 05.03.2024 | 600 | 601 | 0,08 |
| **BAT Capital Corp.** | | | |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | 600 | 602 | 0,08 |
| 3,222 % fällig am 15.08.2024 | 400 | 403 | 0,05 |
| 3,557 % fällig am 15.08.2027 | 1.200 | 1.195 | 0,15 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | |
| 2,979 % fällig am 25.06.2021 | 300 | 298 | 0,04 |
| 3,420 % fällig am 15.12.2023 | 900 | 884 | 0,11 |
| 4,250 % fällig am 15.12.2025 | 1.100 | 1.165 | 0,15 |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028 | 400 | 422 | 0,05 |
| **Campbell Soup Co.** | | | |
| 3,040 % fällig am 15.03.2021 | 1.000 | 998 | 0,12 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2021 | 300 | 304 | 0,04 |
| 3,650 % fällig am 15.03.2023 | 600 | 618 | 0,08 |
| **CenterPoint Energy Resources Corp.** | | | |
| 3,550 % fällig am 01.04.2023 | 300 | 309 | 0,04 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | 4.500 | 4.730 | 0,59 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 (b) | 1.100 | 1.128 | 0,14 |
| **Citigroup, Inc.** | | | |
| 3,142 % fällig am 24.01.2023 | 200 | 203 | 0,03 |
| **CNH Industrial Capital LLC** | | | |
| 3,375 % fällig am 15.07.2019 | $ 300 | $ 300 | 0,04 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.01.2028 | 400 | 421 | 0,05 |
| **CRH America Finance, Inc.** | | | |
| 4,500 % fällig am 04.04.2048 | 300 | 296 | 0,04 |
| **CVS Health Corp.** | | | |
| 3,350 % fällig am 09.03.2021 | 200 | 203 | 0,03 |
| 3,700 % fällig am 09.03.2023 | 600 | 621 | 0,08 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | |
| 3,875 % fällig am 15.09.2021 | 1.100 | 1.132 | 0,14 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | 800 | 825 | 0,10 |
| **Discover Bank** | | | |
| 3,350 % fällig am 06.02.2023 | 400 | 410 | 0,05 |
| **Dresdner Funding Trust** | | | |
| 8,151 % fällig am 30.06.2031 | 200 | 270 | 0,03 |
| **Duke Energy Corp.** | | | |
| 3,028 % fällig am 14.05.2021 | 1.400 | 1.404 | 0,18 |
| **EMC Corp.** | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | 700 | 696 | 0,09 |
| **Emera U.S. Finance LP** | | | |
| 2,700 % fällig am 15.06.2021 | 500 | 502 | 0,06 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.04.2029 | 400 | 447 | 0,06 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | |
| 0,750 % fällig am 21.05.2023 | € 500 | 581 | 0,07 |
| **Fiserv, Inc.** | | | |
| 2,750 % fällig am 01.07.2024 | $ 1.800 | 1.818 | 0,23 |
| **Florida Gas Transmission Co. LLC** | | | |
| 5,450 % fällig am 15.07.2020 | 300 | 308 | 0,04 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | € 1.100 | 1.227 | 0,15 |
| 0,100 % fällig am 07.12.2022 | 200 | 219 | 0,03 |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | 600 | 676 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2021 | $ 400 | 417 | 0,05 |
| **GATX Corp.** | | | |
| 3,285 % fällig am 05.11.2021 | 400 | 398 | 0,05 |
| **General Mills, Inc.** | | | |
| 3,141 % fällig am 16.04.2021 | 200 | 200 | 0,02 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | |
| 0,207 % fällig am 26.03.2022 | € 100 | 112 | 0,01 |
| 3,442 % fällig am 09.04.2021 | $ 200 | 200 | 0,02 |
| 3,550 % fällig am 08.07.2022 | 400 | 407 | 0,05 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 2,908 % fällig am 05.06.2023 | 500 | 506 | 0,06 |
| 4,223 % fällig am 01.05.2029 | 2.100 | 2.254 | 0,28 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | |
| 3,460 % fällig am 02.03.2021 | 800 | 799 | 0,10 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.10.2019 | 500 | 502 | 0,06 |
| **Interpublic Group of Cos., Inc.** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.10.2020 | 1.100 | 1.114 | 0,14 |
| **IPALCO Enterprises, Inc.** | | | |
| 3,450 % fällig am 15.07.2020 | 200 | 201 | 0,03 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | |
| 2,926 % fällig am 26.04.2021 | 1.800 | 1.802 | 0,22 |
| 3,086 % fällig am 26.04.2021 | 1.200 | 1.207 | 0,15 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | |
| 3,115 % fällig am 10.02.2021 | 1.300 | 1.298 | 0,16 |
| 4,875 % fällig am 15.02.2025 | 2.900 | 2.992 | 0,37 |
| **McDonald's Corp.** | | | |
| 3,012 % fällig am 28.10.2021 | 800 | 801 | 0,10 |
| **MidAmerican Energy Co.** | | | |
| 3,650 % fällig am 15.04.2029 | 1.100 | 1.188 | 0,15 |
| **Morgan Stanley** | | | |
| 3,095 % fällig am 10.02.2021 | 400 | 401 | 0,05 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | 1.800 | 1.801 | 0,22 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | |
| 2,930 % fällig am 15.03.2021 | 200 | 200 | 0,02 |
| **ONEOK, Inc.** | | | |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | 300 | 326 | 0,04 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | |
| 3,950 % fällig am 10.03.2025 | 2.100 | 2.205 | 0,28 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | $ 1.108 | $ 1.239 | 0,15 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | 800 | 812 | 0,10 |
| **Sempra Energy** | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | 800 | 797 | 0,10 |
| **Southern Power Co.** | | | |
| 2,937 % fällig am 20.12.2020 | 900 | 900 | 0,11 |
| **Spectra Energy Partners LP** | | | |
| 3,179 % fällig am 05.06.2020 | 300 | 301 | 0,04 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | |
| 3,950 % fällig am 15.06.2023 | 300 | 310 | 0,04 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | 100 | 104 | 0,01 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | 400 | 416 | 0,05 |
| **UIL Holdings Corp.** | | | |
| 4,625 % fällig am 01.10.2020 | 300 | 307 | 0,04 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 3,618 % fällig am 15.05.2025 | 1.900 | 1.926 | 0,24 |
| 4,329 % fällig am 21.09.2028 | 1.390 | 1.542 | 0,19 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | |
| 3,305 % fällig am 13.11.2020 | 1.100 | 1.105 | 0,14 |
| 3,475 % fällig am 12.11.2021 | 1.400 | 1.412 | 0,18 |
| 3,875 % fällig am 13.11.2020 | 700 | 715 | 0,09 |
| 4,000 % fällig am 12.11.2021 | 1.200 | 1.239 | 0,15 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | |
| 3,691 % fällig am 24.01.2023 | 600 | 608 | 0,08 |
| 3,813 % fällig am 31.10.2023 | 2.600 | 2.651 | 0,33 |
| **WRKCo, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 15.03.2025 | 400 | 415 | 0,05 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | 2.100 | 2.134 | 0,27 |
| | | 82.391 | 10,27 |

**KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG**

| | | | |
|---|---|---|---|
| **CenturyLink, Inc.** | | | |
| 5,152 % fällig am 31.01.2025 | 788 | 771 | 0,09 |

**KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL**

| | | | |
|---|---|---|---|
| **American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010** | | | |
| 7,334 % fällig am 15.02.2028 | 1.300 | 1.673 | 0,21 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.06.2047 (d) | 3.700 | 227 | 0,03 |
| | | 1.900 | 0,24 |

**NON-AGENCY-MBS**

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 2,573 % fällig am 20.10.2036 | 94 | 84 | 0,01 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | |
| 3,799 % fällig am 25.07.2037 | 83 | 76 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 4,403 % fällig am 25.05.2035 | 82 | 84 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,593 % fällig am 20.03.2046 | 40 | 37 | 0,01 |
| 2,593 % fällig am 20.05.2046 ^ | 44 | 37 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | 583 | 453 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 252 | 178 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 3,024 % fällig am 25.03.2035 | 523 | 501 | 0,06 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 4,109 % fällig am 26.02.2036 | 3 | 3 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | 303 | 295 | 0,04 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,960 % fällig am 19.06.2036 ^ | 274 | 182 | 0,02 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | 23 | 23 | 0,00 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,644 % fällig am 25.10.2036 | 2.616 | 2.565 | 0,32 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 2,664 % fällig am 25.02.2046 ^ | 385 | 356 | 0,04 |
| **MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,634 % fällig am 25.06.2047 | 2.124 | 2.075 | 0,26 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PAR (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 ^ | $ 435 | $ 302 | 0,04 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | 1.606 | 1.603 | 0,20 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 3,808 % fällig am 20.01.2047 ^ | 34 | 27 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | 53 | 50 | 0,01 |
| 2,724 % fällig am 25.10.2035 | 318 | 308 | 0,04 |
| 4,099 % fällig am 25.10.2036 ^ | 101 | 82 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.07.2046 | 828 | 778 | 0,10 |
| 2,604 % fällig am 25.05.2036 | 388 | 373 | 0,05 |
| 2,614 % fällig am 25.04.2036 | 53 | 52 | 0,01 |
| 3,230 % fällig am 19.10.2033 | 3 | 3 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | |
| 2,684 % fällig am 25.01.2036 | 197 | 183 | 0,02 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,694 % fällig am 25.10.2036 | 736 | 654 | 0,08 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,684 % fällig am 25.11.2045 | 271 | 266 | 0,03 |
| 3,700 % fällig am 25.12.2036 ^ | 125 | 120 | 0,02 |
| 3,904 % fällig am 25.06.2042 | 3 | 3 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 850 | 884 | 0,11 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,730 % fällig am 25.09.2034 | 8 | 8 | 0,00 |
| | | 12.645 | 1,58 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 2,804 % fällig am 25.06.2036 | 49 | 49 | 0,01 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.10.2042 - 01.08.2043 | 2.675 | 2.722 | 0,34 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2043 | $ 75 | $ 78 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.09.2040 | 608 | 642 | 0,08 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2041 | 191 | 205 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2037 - 01.04.2039 | 419 | 459 | 0,06 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2034 - 01.09.2049 | 133.200 | 136.166 | 16,98 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 63.500 | 65.615 | 8,18 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 1,854 % fällig am 15.01.2038 (a) | 694 | 45 | 0,01 |
| 2,859 % fällig am 15.01.2038 | 694 | 691 | 0,09 |
| **Freddie Mac, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 3.000 | 3.025 | 0,38 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 4.300 | 4.447 | 0,55 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 2,847 % fällig am 20.12.2062 | 757 | 755 | 0,09 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 1.100 | 1.136 | 0,14 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 2.600 | 2.695 | 0,34 |
| | | 218.730 | 27,28 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 (i) | 3.887 | 3.858 | 0,48 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 (i) | 18.221 | 18.171 | 2,27 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 | 2.701 | 2.697 | 0,34 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 (i) | 11.087 | 11.213 | 1,40 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 (i) | 23.928 | 24.327 | 3,03 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | 2.215 | 2.269 | 0,28 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | 1.730 | 1.804 | 0,22 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | 2.798 | 2.946 | 0,37 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | 1.096 | 1.245 | 0,16 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 322 | 358 | 0,04 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (i) | 9.665 | 10.803 | 1,35 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | 1.904 | 2.292 | 0,29 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | 1.088 | 1.457 | 0,18 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 1,125 % fällig am 30.06.2021 | $ 300 | $ 296 | 0,04 |
| 2,625 % fällig am 15.06.2021 (i) | 500 | 509 | 0,06 |
| 2,875 % fällig am 30.04.2025 (i) | 15.000 | 15.878 | 1,98 |
| | | 100.123 | 12,49 |
| Summe USA | | 462.720 | 57,71 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (j)** | | | |
| | | 1.055 | 0,13 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 1.055 | 0,13 |
| **AKTIEN** | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | 1.830.189 | 18.329 | 2,28 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 1.133.009** | **141,31** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 161 | $ 22 | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 70 | 31 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 177,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2019 Futures[(1)] | Long | 08/2019 | 123 | 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 178,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2019 Futures[(1)] | Long | 08/2019 | 338 | 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 155,000 GBP auf United Kingdom Gilt September 2019 Futures[(1)] | Long | 08/2019 | 145 | (2) | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 5 | (8) | 0,00 |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09/2019 | 265 | 155 | 0,02 |
| Euro-Bono September Futures | Short | 09/2019 | 30 | (118) | (0,01) |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2019 | 253 | (1.582) | (0,20) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 23 | (46) | (0,01) |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 15 | (119) | (0,01) |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 460 | (1.730) | (0,21) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 129,500 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[(1)] | Long | 08/2019 | 79 | 0 | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 548 | 934 | 0,12 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 414 | 937 | 0,12 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 128 | 1.148 | 0,14 |
| United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate September Futures | Long | 09/2019 | 579 | 336 | 0,04 |
| United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate September Futures | Short | 09/2020 | 579 | (620) | (0,08) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09/2019 | 1 | (2) | 0,00 |
| | | | | $ (664) | (0,08) |

(1) Future-Style-Option.

## OPTIONSKAUF

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | $ 112,000 | 23.08.2019 | 89 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 110,000 | 23.08.2019 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 110,500 | 23.08.2019 | 16 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 111,500 | 23.08.2019 | 68 | 1 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,000 | 23.08.2019 | 315 | 3 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,500 | 23.08.2019 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 114,000 | 23.08.2019 | 128 | 1 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 115,000 | 23.08.2019 | 63 | 1 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 122,000 | 23.08.2019 | 39 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 106,250 | 23.08.2019 | 40 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 106,500 | 23.08.2019 | 6 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 107,000 | 23.08.2019 | 37 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 107,500 | 23.08.2019 | 23 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 108,000 | 23.08.2019 | 564 | 5 | 1 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 108,750 | 23.08.2019 | 3 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 12 | $ 1 | 0,00 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwer | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 127,000 | 26.07.2019 | 50 | $ (20) | $ (61) | (0,01) |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 125,500 | 26.07.2019 | 99 | (33) | (5) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 99 | (35) | (26) | 0,00 |
| | | | | $ (88) | $ (92) | (0,01) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | **$ (755)** | **(0,09)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| BASF SE | (1,000) % | 20.12.2020 | € 600 | $ 8 | 0,00 |
| Fortum Oyj | (1,000) | 20.12.2020 | 100 | 0 | 0,00 |
| Reynolds American, Inc. | (1,000) | 20.12.2020 | $ 1.800 | 28 | 0,00 |
| United Utilities PLC | (1,000) | 20.12.2020 | € 600 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 37 | 0,00 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Marks & Spencer PLC | 1,000 % | 20.06.2023 | € 1.000 | $ 13 | 0,00 |
| Shell International Finance BV | 1,000 | 20.12.2026 | 600 | 44 | 0,01 |
| | | | | $ 57 | 0,01 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 21.900 | $ 383 | 0,05 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 13.700 | 25 | 0,00 |
| iTraxx Crossover 31 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2024 | € 1.400 | 7 | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 22.900 | 76 | 0,01 |
| | | | | $ 491 | 0,06 |

### ZINSSWAPS - BASISSWAPS

| Zahlung variabler Zinssatzindex | Erhalt variabler Zinssatzindex | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,091 % | 18.03.2022 | $ 213.700 | $ 23 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,084 % | 12.06.2022 | 9.100 | 7 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,070 % | 12.06.2022 | 6.600 | 7 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,085 % | 19.06.2022 | 34.000 | 26 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,098 % | 02.03.2023 | 13.600 | 5 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,086 % | 12.04.2023 | 20.900 | 5 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,088 % | 23.05.2029 | 1.700 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 73 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

## 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 | 2,673 % | 30.04.2025 | $ 1.600 | $ (102) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,683 | 30.04.2025 | 5.000 | (323) | (0,04) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,684 | 30.04.2025 | 1.600 | (103) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,696 | 30.04.2025 | 1.600 | (104) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,710 | 30.04.2025 | 1.700 | (112) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,714 | 30.04.2025 | 3.300 | (218) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,370 | 02.01.2020 | BRL 302.400 | (138) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,450 | 02.01.2020 | 271.200 | (163) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,880 | 04.01.2021 | 29.300 | 459 | 0,06 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 9,600 | 04.01.2027 | 42.500 | (1.288) | (0,16) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,750 | 16.12.2046 | CAD 2.300 | (136) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,500 | 19.06.2029 | 25.600 | 931 | 0,12 |
| Erhalt | 3-Month NZD-BBR | 2,500 | 14.02.2020 | NZD 24.880 | 201 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month PLN-WIBOR | 3,000 | 19.09.2028 | PLN 4.600 | 118 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 0,500 | 19.06.2024 | SEK 12.700 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 20.06.2020 | $ 23.900 | (399) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 20.12.2019 | 8.000 | 70 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 20.06.2023 | 44.700 | (2.278) | (0,28) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 16.800 | (1.523) | (0,19) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,460 | 09.04.2024 | 8.100 | (246) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 5.100 | (880) | (0,11) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2020 | 7.300 | (150) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2023 | 3.000 | (170) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 9.200 | (769) | (0,10) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2021 | 6.000 | 7 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 6.500 | (43) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 3.300 | (82) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2026 | 7.200 | (350) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2028 | 1.200 | (84) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 28.400 | (1.305) | (0,16) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 3.800 | 25 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 6.000 | (1.193) | (0,15) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 18.12.2049 | 700 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,750 | 15.03.2022 | ZAR 66.400 | 176 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,250 | 15.03.2022 | 9.600 | 22 | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.09.2021 | € 70.900 | (198) | (0,02) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2021 | 19.700 | (13) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2024 | 24.600 | 119 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | 19.900 | 453 | 0,06 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 18.12.2029 | 32.600 | 379 | 0,05 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | 41.550 | 2.086 | 0,26 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 08.03.2029 | 9.900 | 317 | 0,04 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | 1.700 | 24 | 0,00 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,310 | 19.06.2029 | 31.900 | 313 | 0,04 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.09.2021 | £ 21.300 | 168 | 0,02 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2024 | 5.500 | 6 | 0,00 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2029 | 8.500 | (31) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.12.2020 | 58.500 | 377 | 0,05 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 16.12.2021 | 58.500 | (515) | (0,06) |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 400 | (38) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,200 | 19.06.2029 | ¥ 4.720.000 | (365) | (0,05) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,400 | 19.06.2039 | 560.000 | (129) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,500 | 19.06.2049 | 280.000 | 113 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,070 | 03.02.2021 | MXN 5.000 | (10) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,555 | 25.01.2023 | 13.600 | 23 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,715 | 15.10.2021 | 20.900 | (31) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,000 | 18.07.2022 | 22.900 | (44) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,080 | 10.03.2026 | 68.000 | 134 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,740 | 22.02.2027 | 17.500 | 20 | 0,00 |
| | | | | | $ (6.990) | (0,86) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (6.332)** | **(0,79)** |

(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.

(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.

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

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

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

## OPTIONSKAUF

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC USD versus CAD | CAD 1,390 | 19.07.2019 | 13.000 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |
| HUS | Call - OTC AUD versus CAD | 0,940 | 13.09.2019 | 5.600 | 16 | 12 | 0,00 |
| | Put - OTC EUR versus USD | $ 1,070 | 18.07.2019 | 40.000 | 4 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus INR | INR 82,000 | 16.10.2019 | 11.700 | 83 | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ 104 | $ 13 | 0,00 |

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FAR | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 76,000 | 06.08.2019 | 50.000 | $ 2 | $ 0 | 0,00 |
| JPM | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 70,000 | 08.07.2019 | 22.500 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 3 | $ 0 | 0,00 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 % | 21.08.2019 | 1.500 | $ (2) | $ 0 | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 1.500 | (1) | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 1.500 | (2) | (1) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 300 | 0 | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 1.700 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 3.000 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 1.900 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 1.900 | (4) | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.500 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (18) | $ (3) | 0,00 |

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Put - OTC USD versus COP | COP 3.165,000 | 29.08.2019 | 2.710 | $ (22) | $ (23) | 0,00 |
| | Put - OTC USD versus ZAR | ZAR 14,200 | 18.07.2019 | 1.840 | (11) | (29) | (0,01) |
| HUS | Put - OTC AUD versus CAD | CAD 0,905 | 13.09.2019 | 5.600 | (17) | (22) | 0,00 |
| | Put - OTC USD versus CNH | CNH 6,795 | 22.07.2019 | 4.010 | (11) | (9) | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus CNH | 6,945 | 22.07.2019 | 4.010 | (7) | (12) | 0,00 |
| | | | | | $ (68) | $ (95) | (0,01) |

### INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | | | | | | | | |
| | Floor - OTC CPURNSA | $ 218,011 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 13.10.2020 | 400 | $ (4) | $ 0 | 0,00 |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Japan Government International Bond | (1,000) % | 20.06.2022 | $ 400 | $ (14) | $ 3 | $ (11) | 0,01 |
| BPS | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 3.100 | (111) | 29 | (82) | (0,01) |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 2.100 | (52) | (10) | (62) | (0,01) |
| BRC | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.200 | (23) | (9) | (32) | 0,00 |
| | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 2.200 | (77) | 18 | (59) | (0,01) |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 3.200 | (80) | (14) | (94) | (0,01) |
| CBK | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 1.500 | (52) | 12 | (40) | (0,01) |
| GST | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 2.200 | (42) | (16) | (58) | (0,01) |
| | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 2.800 | (98) | 24 | (74) | (0,01) |
| HUS | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.200 | (30) | (5) | (35) | 0,00 |
| JPM | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.700 | (41) | (9) | (50) | (0,01) |
| | | | | | $ (620) | $ 23 | $ (597) | (0,07) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.03.2020 | $ 1.400 | $ (63) | $ 68 | $ 5 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (5) | 4 | (1) | 0,00 |
| BRC | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 2.000 | (75) | 103 | 28 | 0,00 |
| CBK | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 900 | (30) | 10 | (20) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 1.900 | (25) | 51 | 26 | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.600 | (16) | 23 | 7 | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 3.600 | (53) | 81 | 28 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 5.400 | (173) | 210 | 37 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (5) | 4 | (1) | 0,00 |
| DUB | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 2.700 | (96) | 98 | 2 | 0,00 |
| FBF | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 500 | (33) | 39 | 6 | 0,00 |
| GST | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 700 | (41) | 42 | 1 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 800 | (26) | 8 | (18) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 1.900 | (28) | 45 | 17 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 2.600 | (85) | 103 | 18 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 1.400 | (60) | 55 | (5) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 700 | (31) | 9 | (22) | 0,00 |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 2.400 | (164) | 170 | 6 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 400 | (12) | 3 | (9) | 0,00 |
| JPM | AP Moller -Maersk | 1,000 | 20.06.2022 | € 1.700 | (10) | 28 | 18 | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.03.2020 | $ 7.500 | (247) | 294 | 47 | 0,01 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 300 | (16) | 12 | (4) | 0,00 |
| | | | | | $ (1.294) | $ 1.460 | $ 166 | 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.

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

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

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,480 % | 18.05.2027 | THB 4.000 | $ 0 | $ 7 | $ 7 | 0,00 |
| | Zahlung | 6-Month THB-THBFIX | 2,810 | 18.05.2037 | 52.000 | 0 | 192 | 192 | 0,02 |
| GLM | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,785 | 20.03.2029 | KRW 568.100 | 0 | 16 | 16 | 0,00 |
| JPM | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,017 | 01.03.2024 | ILS 64.300 | 0 | 304 | 304 | 0,04 |
| | Erhalt | 3-Month COP-IBR Compounded-OIS | (5,960) | 11.02.2029 | COP 1.904.600 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| NGF | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,725 | 20.03.2024 | KRW 3.306.000 | 0 | 41 | 41 | 0,01 |
| SCX | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,795 | 20.03.2029 | 571.000 | 0 | 17 | 17 | 0,00 |
| | | | | | | $ 0 | $ 541 | $ 541 | 0,07 |

## 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 | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | Month USD-LIBOR | $ 3.600 | 20.03.2020 | $ 22 | $ (122) | $ (100) | (0,01) |
| GST | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | Month USD-LIBOR | 2.500 | 20.09.2019 | 0 | (185) | (185) | (0,03) |
| JPM | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | Month USD-LIBOR | 1.700 | 20.09.2019 | 2 | (100) | (98) | (0,01) |
| MYC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | Month USD-LIBOR | 2.500 | 20.09.2019 | 3 | (150) | (147) | (0,02) |
| | | | | | | | $ 27 | $ (557) | $ (530) | (0,07) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 08/2019 | $ 2.719 | AUD 3.908 | $ 27 | $ 0 | $ 27 | 0,00 |
| BOA | 07/2019 | AUD 1.082 | $ 742 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD 2.032 | 1.529 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK 7.375 | 1.109 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 3.237 | AUD 4.646 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07/2019 | 2.460 | CLP 1.669.050 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | 25 | € 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | 760 | £ 598 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | 11 | NOK 98 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | 3.854 | NZD 5.926 | 126 | 0 | 126 | 0,02 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | € | 3.072 | $ | 3.486 | $ 0 | $ (25) | $ (25) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.355 | CAD | 3.160 | 66 | 0 | 66 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 3.847 | € | 3.397 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 48.432 | $ | 6.984 | 0 | (60) | (60) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 1.318 | ILS | 4.693 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 2.570 | € | 518 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | AUD | 4.633 | $ | 3.225 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 1.069 | | 812 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 1.563 | | 1.606 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 4.783 | | 5.374 | 0 | (74) | (74) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 1.766 | | 2.252 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 88.047 | | 824 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 278 | | 32 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | RON | 11.961 | | 2.840 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.197 | CNH | 8.202 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.164 | € | 1.924 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 24.255 | £ | 19.123 | 83 | 0 | 83 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 2.186 | NZD | 3.329 | 50 | 0 | 50 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 768 | RUB | 49.646 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.551 | VND | 36.303.350 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 19.123 | $ | 24.292 | 0 | (84) | (84) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 539 | ARS | 24.051 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | | 100 | CAD | 135 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 28.393 | ¥ | 3.091.600 | 396 | 0 | 396 | 0,05 |
| | 09/2019 | € | 64 | TRY | 434 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | PEN | 5.355 | $ | 1.600 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 2.917 | CNH | 20.230 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.086 | IDR | 15.677.226 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 11.373 | KRW | 13.484.049 | 300 | 0 | 300 | 0,04 |
| | 09/2019 | | 1.384 | PEN | 4.668 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 10/2019 | INR | 194.167 | $ | 2.760 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 2.241 | € | 451 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 05/2020 | $ | 6.508 | INR | 478.143 | 158 | 0 | 158 | 0,02 |
| BRC | 07/2019 | DKK | 16.880 | $ | 2.572 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 255.800 | | 2.365 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 698 | HKD | 5.465 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 127 | MXN | 2.442 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.327 | NOK | 19.900 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 1.188 | TWD | 36.828 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 5.465 | $ | 699 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 04/2020 | INR | 481.079 | | 6.631 | 0 | (81) | (81) | (0,01) |
| CBK | 07/2019 | CHF | 2.273 | | 2.279 | 0 | (52) | (52) | (0,01) |
| | 07/2019 | CLP | 1.669.050 | | 2.464 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | CNH | 8.408 | | 1.247 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 43.875 | | 6.671 | 1 | (24) | (23) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 274 | | 312 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 19.642 | | 2.246 | 0 | (57) | (57) | (0,01) |
| | 07/2019 | SEK | 28.928 | | 3.078 | 0 | (41) | (41) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 2.280 | AUD | 3.278 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 637 | BRL | 2.482 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 764 | CAD | 1.013 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.196 | CNH | 8.202 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 31.061 | DKK | 204.229 | 100 | 0 | 100 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 2.783 | £ | 2.192 | 8 | (1) | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 771 | ¥ | 83.440 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.145 | PLN | 11.736 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 6.341 | SEK | 59.390 | 61 | 0 | 61 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 329 | TRY | 1.914 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 5.371 | $ | 3.994 | 0 | (120) | (120) | (0,01) |
| | 08/2019 | € | 28.077 | | 31.881 | 0 | (206) | (206) | (0,03) |
| | 08/2019 | ¥ | 149.400 | | 1.379 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 36.765 | | 1.857 | 0 | (43) | (43) | (0,01) |
| | 08/2019 | NOK | 1 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 1.260 | | 134 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 11.473 | AUD | 16.387 | 44 | 0 | 44 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 15.089 | CAD | 20.214 | 394 | 0 | 394 | 0,05 |
| | 08/2019 | | 17.498 | € | 15.540 | 262 | 0 | 262 | 0,03 |
| | 08/2019 | | 1.300 | HKD | 10.179 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 792 | ¥ | 86.100 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 5.902 | NOK | 50.980 | 91 | (5) | 86 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 2.630 | RUB | 173.008 | 96 | 0 | 96 | 0,01 |
| | 09/2019 | CNH | 45.073 | $ | 6.495 | 0 | (60) | (60) | (0,01) |
| | 09/2019 | € | 276 | TRY | 1.875 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 2.464 | CLP | 1.669.050 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 404 | KRW | 478.605 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.195 | KZT | 461.868 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 204.229 | $ | 31.301 | 0 | (99) | (99) | (0,01) |
| | 10/2019 | PEN | 35.331 | | 10.576 | 0 | (120) | (120) | (0,01) |
| | 10/2019 | $ | 4.673 | MXN | 91.675 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 1.725 | RON | 7.396 | 51 | 0 | 51 | 0,01 |
| | 12/2019 | HKD | 10.179 | $ | 1.301 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 2.257 | € | 455 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | 07/2019 | $ | 1.176 | TRY | 6.816 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 677 | CNH | 4.694 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 10 | IDR | 144.360 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.661 | PHP | 86.582 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 661 | TWD | 20.617 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| FBF | 09/2019 | | 18.138 | INR | 1.273.320 | 126 | 0 | 126 | 0,02 |
| | 11/2019 | | 771 | TWD | 24.071 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | CHF | 779 | $ | 803 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | CLP | 1.314.992 | | 1.940 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 2.195 | | 331 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 1.993 | | 2.529 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 4.702 | | 1.421 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 406 | COP | 1.297.576 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.334 | £ | 1.833 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 759 | NZD | 1.154 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 51.000 | $ | 467 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 25.108 | | 1.263 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 304.815 | | 31.842 | 0 | (1.117) | (1.117) | (0,14) |
| | 08/2019 | $ | 4.600 | MXN | 91.675 | 139 | 0 | 139 | 0,02 |
| | 09/2019 | RUB | 34.912 | $ | 530 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 1.940 | CLP | 1.314.992 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 247 | IDR | 3.622.431 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 336 | INR | 23.703 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 5.392 | THB | 168.596 | 116 | 0 | 116 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 4.813 | TWD | 150.892 | 77 | 0 | 77 | 0,01 |
| | 10/2019 | MXN | 91.675 | $ | 4.550 | 0 | (139) | (139) | (0,02) |
| | 10/2019 | $ | 8.844 | MXN | 171.946 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 1.690 | RON | 7.208 | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| | 03/2020 | € | 331 | | 1.610 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CNH | 56.343 | $ | 8.255 | 57 | 0 | 57 | 0,01 |
| | 07/2019 | € | 75 | | 86 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | KRW | 1.165 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 2.429 | | 1.608 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 406 | BRL | 1.555 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 759 | CAD | 1.022 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.329 | CLP | 924.718 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 8.609 | CNH | 59.082 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 12.998 | € | 11.432 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.076 | NOK | 26.802 | 67 | 0 | 67 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 21.091 | RUB | 1.398.014 | 1.032 | 0 | 1.032 | 0,13 |
| | 07/2019 | | 4.496 | TRY | 26.298 | 36 | (2) | 34 | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 3.463 | $ | 2.582 | 0 | (70) | (70) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 1.854 | € | 1.634 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 4.174 | HKD | 32.714 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 5.480 | ¥ | 590.000 | 16 | (2) | 14 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.271 | SEK | 20.990 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 2.739 | $ | 2.004 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 6.157 | CNH | 42.392 | 19 | (11) | 8 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.410 | IDR | 20.364.209 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.059 | INR | 74.710 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 10/2019 | INR | 162.954 | $ | 2.217 | 0 | (111) | (111) | (0,01) |
| | 10/2019 | $ | 5.628 | INR | 407.015 | 188 | 0 | 188 | 0,02 |
| | 10/2019 | | 3.474 | PEN | 11.686 | 63 | 0 | 63 | 0,01 |
| | 11/2019 | TWD | 58.054 | $ | 1.855 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 11/2019 | $ | 1.186 | TWD | 36.974 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 25.875 | $ | 3.310 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 04/2020 | $ | 6.556 | INR | 481.079 | 156 | 0 | 156 | 0,02 |
| JPM | 07/2019 | CHF | 1.514 | $ | 1.512 | 0 | (41) | (41) | (0,01) |
| | 07/2019 | CNH | 3.131 | | 460 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 136.930 | | 20.899 | 22 | (15) | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 2.523 | RON | 11.961 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 2.309 | $ | 2.907 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 07/2019 | INR | 458.814 | | 6.541 | 0 | (102) | (102) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 181.486 | | 1.673 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | KRW | 429.811 | | 369 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.082 | CHF | 3.044 | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 534 | DKK | 3.520 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.045 | £ | 3.210 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 3.430 | INR | 238.866 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.424 | PEN | 4.702 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 976 | PLN | 3.645 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 760 | SEK | 7.221 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 519 | TRY | 3.014 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 3.139 | $ | 3.583 | 4 | (8) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 11.075 | | 559 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 4.705 | | 678 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 515 | IDR | 7.430.432 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 8.351 | $ | 2.513 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 11.961 | € | 2.500 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 05/2020 | INR | 238.866 | $ | 3.315 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | CNH | 7.605 | | 1.113 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 289 | BRL | 1.137 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09/2019 | RUB | 1.310.053 | $ | 19.798 | $ 0 | $ (749) | $ (749) | (0,09) |
| | 03/2020 | RON | 2.260 | € | 455 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | AUD | 2.196 | $ | 1.531 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 850 | | 852 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 27.445 | | 3.235 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.705 | ZAR | 98.300 | 260 | 0 | 260 | 0,03 |
| | 08/2019 | | 9.123 | CHF | 9.098 | 246 | 0 | 246 | 0,03 |
| | 08/2019 | | 815 | HKD | 6.382 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 285 | SEK | 2.720 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 6.382 | $ | 816 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 06/2021 | $ | 52 | € | 41 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| NGF | 09/2019 | TRY | 2.314 | | 340 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| RBC | 07/2019 | COP | 1.297.576 | $ | 408 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 406 | COP | 1.297.576 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | BRL | 63.255 | $ | 16.505 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 29.089 | | 460 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 565 | CLP | 390.274 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 16.457 | BRL | 63.255 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 20.407 | $ | 25.829 | 0 | (143) | (143) | (0,02) |
| | 07/2019 | ¥ | 412.636 | | 3.803 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| | 07/2019 | KRW | 1.919.920 | | 1.648 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 14.410 | BRL | 58.081 | 745 | 0 | 745 | 0,09 |
| | 07/2019 | | 3.757 | £ | 2.975 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.519 | ¥ | 164.485 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 2.441 | $ | 2.746 | 0 | (43) | (43) | (0,01) |
| | 08/2019 | ¥ | 92.000 | | 853 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.101 | CZK | 25.214 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 5.340 | $ | 770 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 1.550 | CNH | 10.719 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 211 | TWD | 6.573 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | | 1.070 | HUF | 294.721 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.034 | PLN | 15.185 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | DKK | 1.515 | $ | 229 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.165 | INR | 219.948 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 7.704 | ¥ | 840.000 | 101 | 0 | 101 | 0,01 |
| | 08/2019 | HKD | 60.351 | $ | 7.716 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 578 | CHF | 575 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.342 | ¥ | 253.400 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 8.913 | MXN | 171.946 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 171.946 | $ | 8.830 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 05/2020 | INR | 239.277 | | 3.328 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| TOR | 08/2019 | $ | 5.816 | CAD | 7.786 | 148 | 0 | 148 | 0,02 |
| | 08/2019 | | 279 | MXN | 5.400 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 5.938 | COP | 20.069.661 | 288 | 0 | 288 | 0,04 |
| UAG | 07/2019 | ¥ | 840.000 | $ | 7.580 | 0 | (226) | (226) | (0,03) |
| | 07/2019 | NZD | 4.633 | | 3.068 | 0 | (44) | (44) | (0,01) |
| | 07/2019 | TRY | 12.015 | | 2.017 | 0 | (56) | (56) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 4.267 | TRY | 25.253 | 84 | 0 | 84 | 0,01 |
| | 08/2019 | HKD | 10.666 | $ | 1.364 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 46.893 | € | 41.441 | 468 | 0 | 468 | 0,06 |
| | 09/2019 | | 1.811 | MYR | 7.527 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 03/2020 | € | 1.586 | RON | 7.718 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | | | $ 7.793 | $ (4.782) | $ 3.011 | 0,38 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 867 | $ | 596 | $ 0 | $ (13) | $ (13) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 1.003 | | 748 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 935 | | 141 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.761 | AUD | 3.954 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.483 | CAD | 4.582 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 31.607 | CHF | 31.703 | 908 | 0 | 908 | 0,11 |
| | 08/2019 | AUD | 3.954 | $ | 2.764 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 4.582 | | 3.486 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 944 | | 1.190 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 136 | | 89 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 21.103 | CHF | 21.063 | 500 | 0 | 500 | 0,06 |
| | 07/2019 | | 5.456 | £ | 4.301 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 4.301 | $ | 5.464 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € | 17.411 | | 19.472 | 0 | (355) | (355) | (0,05) |
| CBK | 07/2019 | AUD | 3.087 | | 2.137 | 0 | (29) | (29) | (0,01) |
| | 07/2019 | CHF | 41.272 | | 42.148 | 0 | (182) | (182) | (0,02) |
| | 07/2019 | ¥ | 811.830 | | 7.452 | 0 | (83) | (83) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 11.484 | CHF | 11.509 | 320 | 0 | 320 | 0,04 |
| | 07/2019 | | 26.159 | € | 23.017 | 53 | 0 | 53 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 913 | NOK | 7.764 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | € | 23.017 | $ | 26.226 | $ 0 | $ (53) | $ (53) | (0,01) |
| | 08/2019 | NOK | 7.764 | | 914 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 42.270 | CHF | 41.272 | 184 | 0 | 184 | 0,02 |
| GLM | 07/2019 | € | 5.046 | $ | 5.666 | 0 | (81) | (81) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 31.643 | CHF | 31.849 | 1.023 | 0 | 1.023 | 0,13 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 3.579 | $ | 2.655 | 0 | (84) | (84) | (0,01) |
| | 07/2019 | CHF | 41.336 | | 42.310 | 0 | (86) | (86) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 42.433 | CHF | 41.336 | 88 | 0 | 88 | 0,01 |
| IND | 07/2019 | SEK | 7.831 | $ | 817 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| RYL | 07/2019 | DKK | 3.330 | | 505 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | SEK | 2.185 | | 230 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 560 | | 629 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 3.357 | | 4.249 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 6.063 | | 693 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.080 | SEK | 10.016 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 10.016 | $ | 1.083 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | ¥ | 226.769 | | 2.090 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 1.701 | | 195 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 482 | | 317 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | $ | 9.649 | ¥ | 1.038.599 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 1.038.599 | $ | 9.672 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | | | | | | $ 3.143 | $ (1.185) | $ 1.958 | 0,24 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional DKK (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CHF | 959 | $ | 956 | $ 0 | $ (27) | $ (27) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 150.000 | | 22.839 | 0 | (47) | (47) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 1.822 | AUD | 2.609 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.293 | CAD | 3.016 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 2.609 | $ | 1.824 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 3.016 | | 2.295 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 22.902 | DKK | 150.000 | 48 | 0 | 48 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | | 3.515 | £ | 2.771 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 2.771 | $ | 3.521 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 2.609 | | 1.806 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 713.227 | | 6.547 | 0 | (73) | (73) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 17.675 | € | 15.552 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 600 | NOK | 5.104 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 15.552 | $ | 17.720 | 0 | (36) | (36) | (0,01) |
| | 08/2019 | NOK | 5.104 | | 601 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 15.552 | | 17.360 | 0 | (350) | (350) | (0,05) |
| HUS | 07/2019 | CAD | 3.016 | | 2.237 | 0 | (71) | (71) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 982 | CHF | 959 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 19.821 | DKK | 132.375 | 376 | 0 | 376 | 0,05 |
| | 08/2019 | CHF | 959 | $ | 984 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| IND | 07/2019 | SEK | 6.402 | | 668 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | NOK | 5.104 | | 584 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 22.722 | DKK | 148.746 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | | 1.003 | | 6.602 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 2.771 | $ | 3.508 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 690 | SEK | 6.402 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 6.402 | $ | 692 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | NZD | 417 | | 274 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 21.855 | DKK | 146.085 | 434 | 0 | 434 | 0,05 |
| UAG | 07/2019 | | 576 | | 3.822 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 6.626 | ¥ | 713.227 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 713.227 | $ | 6.642 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | | | | | | $ 951 | $ (764) | $ 187 | 0,02 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CHF | 5.931 | $ | 5.913 | $ 0 | $ (170) | $ (170) | (0,02) |
| | 07/2019 | € | 103.772 | | 117.926 | 0 | (249) | (249) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 9.687 | AUD | 13.871 | 47 | 0 | 47 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 12.877 | CAD | 16.935 | 83 | 0 | 83 | 0,01 |
| | 08/2019 | AUD | 13.871 | $ | 9.697 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| | 08/2019 | CAD | 16.387 | | 12.467 | 0 | (82) | (82) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 118.227 | € | 103.772 | 251 | 0 | 251 | 0,03 |
| BPS | 07/2019 | £ | 253 | $ | 322 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 284 | € | 254 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 20.207 | £ | 15.932 | 69 | 0 | 69 | 0,01 |
| | 08/2019 | £ | 15.932 | $ | 20.238 | 0 | (70) | (70) | (0,01) |
| BRC | 07/2019 | $ | 111.113 | € | 99.351 | 2.028 | 0 | 2.028 | 0,26 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | AUD | 13.871 | $ | 9.603 | $ 0 | $ (131) | $ (131) | (0,02) |
| | 07/2019 | € | 137.990 | | 156.826 | 0 | (317) | (317) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 2.685 | DKK | 17.652 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 693 | € | 609 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.172 | NOK | 26.983 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08/2019 | NOK | 26.983 | $ | 3.175 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 157.226 | € | 137.990 | 319 | 0 | 319 | 0,04 |
| | 10/2019 | DKK | 17.652 | $ | 2.705 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | $ | 4.328 | € | 3.817 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 16.387 | $ | 12.156 | 0 | (384) | (384) | (0,05) |
| | 07/2019 | $ | 6.071 | CHF | 5.931 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 36.433 | ¥ | 3.920.692 | 0 | (42) | (42) | (0,01) |
| | 08/2019 | CHF | 5.931 | $ | 6.088 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 3.920.692 | | 36.519 | 41 | 0 | 41 | 0,01 |
| IND | 07/2019 | SEK | 36.886 | | 3.848 | 0 | (128) | (128) | (0,02) |
| JPM | 07/2019 | DKK | 17.652 | | 2.681 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 3.858.427 | | 35.400 | 0 | (412) | (412) | (0,05) |
| SCX | 07/2019 | £ | 15.679 | | 19.845 | 0 | (110) | (110) | (0,01) |
| | 07/2019 | NOK | 26.983 | | 3.083 | 0 | (81) | (81) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 4.781 | € | 4.242 | 50 | 0 | 50 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 3.978 | SEK | 36.886 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 36.886 | $ | 3.987 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | NZD | 1.937 | | 1.273 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | ¥ | 62.265 | | 574 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 149.269 | € | 133.489 | 2.749 | 0 | 2.749 | 0,34 |
| | | | | | | $ 5.691 | $ (2.299) | $ 3.392 | 0,43 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CHF | 467 | $ | 465 | $ 0 | $ (13) | $ (13) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 865 | AUD | 1.239 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.127 | CAD | 1.482 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 1.239 | $ | 866 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 1.482 | | 1.128 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 10.811 | | 13.712 | 0 | (47) | (47) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 269 | € | 239 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 13.733 | £ | 10.811 | 47 | 0 | 47 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | € | 7.746 | $ | 8.663 | 0 | (158) | (158) | (0,02) |
| CBK | 07/2019 | AUD | 1.239 | | 858 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 10.745 | | 13.652 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 357.805 | | 3.284 | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 8.531 | € | 7.507 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 13.424 | £ | 10.595 | 60 | 0 | 60 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 294 | NOK | 2.499 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 7.507 | $ | 8.553 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 08/2019 | NOK | 2.499 | | 294 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 13.673 | £ | 10.745 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 343 | | 272 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 1.482 | $ | 1.100 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 478 | CHF | 467 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | CHF | 467 | $ | 479 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| IND | 07/2019 | SEK | 2.901 | | 303 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | NOK | 2.499 | | 286 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | DKK | 1.384 | | 210 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | $ | 13.410 | £ | 10.595 | 74 | 0 | 74 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 313 | SEK | 2.901 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 2.901 | $ | 314 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | NZD | 157 | | 103 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.150 | £ | 2.493 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 3.324 | ¥ | 357.805 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 357.805 | $ | 3.332 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | | | $ 266 | $ (378) | $ (112) | (0,01) |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CHF | 603 | $ | 601 | $ 0 | $ (17) | $ (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.099 | AUD | 1.573 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.527 | CAD | 2.009 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 1.573 | $ | 1.100 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 2.009 | | 1.529 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 73 | | 92 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.261 | £ | 1.783 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 1.783 | $ | 2.265 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | 07/2019 | € 9.778 | $ 10.936 | $ 0 | $ (201) | $ (201) | (0,02) |
| | 07/2019 | NOK 154.281 | 18.133 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 18.152 | NOK 154.281 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD 1.573 | $ 1.089 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD 146 | 111 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | € 160 | 182 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ 457.242 | 4.197 | 0 | (47) | (47) | (0,01) |
| | 07/2019 | NOK 154.159 | 18.120 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 11.295 | € 9.938 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 08/2019 | € 9.938 | $ 11.323 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 18.139 | NOK 154.159 | 0 | (39) | (39) | (0,01) |
| FBF | 07/2019 | 422 | 3.672 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD 1.863 | $ 1.382 | 0 | (44) | (44) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 617 | CHF 603 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | CHF 603 | $ 619 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| IND | 07/2019 | SEK 4.106 | 428 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | $ 17.469 | NOK 152.753 | 447 | 0 | 447 | 0,06 |
| MYI | 07/2019 | 6.149 | 53.758 | 156 | 0 | 156 | 0,02 |
| RYL | 07/2019 | DKK 1.851 | $ 281 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ 1.783 | 2.257 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 17.456 | NOK 152.753 | 461 | 0 | 461 | 0,06 |
| | 07/2019 | 443 | SEK 4.106 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK 4.106 | $ 444 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | NZD 244 | 160 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | $ 4.248 | ¥ 457.242 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ 457.242 | $ 4.258 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | $ 1.201 | $ (486) | $ 715 | 0,09 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 8.646** | **1,08** |
| **Summe Anlagen** | **$ 1.134.568** | **141,51** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (332.784)** | **(41,51)** |
| **Nettovermögen** | **$ 801.784** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(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) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 122.557 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.804 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 11.636 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 920 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 1.055 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (1.077) | $ 1.055 | $ 1.055 | 0,13 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.077)** | **$ 1.055** | **$ 1.055** | **0,13** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 26.261 | $ 1.106.748 | $ 0 | $ 1.133.009 |
| Finanzderivate[3] | (755) | 2.314 | 0 | 1.559 |
| **Summen** | **$ 25.506** | **$ 1.109.062** | **$ 0** | **$ 1.134.568** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 9.701 | $ 1.022.474 | $ 0 | $ 1.032.175 |
| Finanzderivate[3] | (3.627) | 714 | 0 | (2.913) |
| **Summen** | **$ 6.074** | **$ 1.023.188** | **$ 0** | **$ 1.029.262** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (0,370) % | 17.04.2019 | 18.07.2019 | € (25.502) | $ (29.020) | (3,62) |
| | (0,300) | 17.04.2019 | 18.07.2019 | (6.303) | (7.174) | (0,89) |
| | 0,900 | 17.04.2019 | 09.08.2019 | £ (7.263) | (9.261) | (1,16) |
| GRE | 2,560 | 17.05.2019 | 17.07.2019 | $ (9.803) | (9.834) | (1,23) |
| | 2,610 | 30.04.2019 | 22.07.2019 | (4.435) | (4.455) | (0,56) |
| IND | 2,560 | 09.05.2019 | 07.08.2019 | (6.657) | (6.682) | (0,83) |
| | 2,570 | 16.05.2019 | 16.07.2019 | (22.251) | (22.324) | (2,78) |
| | 2,590 | 23.04.2019 | 23.07.2019 | (19.363) | (19.459) | (2,43) |
| | 2,600 | 06.06.2019 | 18.07.2019 | (10.733) | (10.752) | (1,34) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (118.961)** | **(14,84)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/ verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 27 | $ 0 | $ 27 |
| BOA | 741 | (450) | 291 |
| BPS | 1.186 | (1.210) | (24) |
| BRC | 972 | (1.140) | (168) |
| CBK | 526 | (380) | 146 |
| DUB | 38 | (40) | (2) |
| FBF | 151 | 0 | 151 |
| GLM | (396) | 290 | (106) |
| GST | (328) | 210 | (118) |
| HUS | 1.186 | (1.110) | 76 |
| IND | (201) | 0 | (201) |
| JPM | 67 | 0 | 67 |
| MSB | (747) | 0 | (747) |
| MYC | (147) | (440) | (587) |
| MYI | 655 | 300 | 955 |
| NGF | 44 | 0 | 44 |
| RYL | 7 | (30) | (23) |
| SCX | 913 | (990) | (77) |
| SOG | 11 | (360) | (349) |
| SSB | 521 | 0 | 521 |
| TOR | 3.181 | (3.210) | (29) |
| UAG | 239 | 0 | 239 |

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

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Fund (Forts.)

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 93,99 | 80,19 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 47,19 | 60,68 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,13 | 0,15 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,09) | (0,50) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,79) | 0,08 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,08 | 0,02 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (14,84) | (16,07) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,07 | 0,08 |
| Australien | 0,36 | 0,44 |
| Belgien | 0,11 | 0,11 |
| Brasilien | 1,31 | 1,33 |
| Kanada | 1,33 | 3,37 |
| Cayman-Inseln | 3,86 | 4,39 |
| China | 0,99 | 0,00 |
| Kolumbien | 0,37 | 0,26 |
| Tschechische Republik | 0,06 | 0,06 |
| Dänemark | 4,48 | 3,15 |
| Frankreich | 2,53 | 3,27 |
| Deutschland | 2,48 | 1,97 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,21 | 0,21 |
| Hongkong | 0,52 | 0,67 |
| Indien | 0,77 | 0,31 |
| Indonesien | 3,90 | 4,16 |
| Irland | 2,82 | 2,50 |
| Israel | 0,31 | 0,31 |
| Italien | 6,17 | 5,02 |
| Japan | 8,25 | 6,25 |
| Kuwait | 1,34 | 1,38 |
| Litauen | 0,16 | 0,17 |
| Luxemburg | 1,33 | 1,29 |
| Malaysia | 0,11 | 0,20 |
| Mexiko | 0,35 | 0,33 |
| Multinational | 0,22 | 0,25 |
| Niederlande | 3,55 | 3,66 |
| Norwegen | 0,53 | 0,57 |
| Peru | 1,95 | 2,26 |
| Philippinen | 0,11 | 0,10 |
| Portugal | 0,09 | 0,11 |
| Katar | 1,16 | 0,82 |
| Rumänien | 0,09 | 0,10 |
| Russland | 2,34 | 0,00 |
| Saudi-Arabien | 2,58 | 2,38 |
| Singapur | 0,96 | 1,05 |
| Slowenien | 0,32 | 0,52 |
| Südafrika | 0,11 | 0,11 |
| Südkorea | 0,43 | 0,04 |
| Spanien | 3,15 | 1,09 |
| Supranational | 0,08 | 0,00 |
| Schweden | 4,56 | 6,08 |
| Schweiz | 0,81 | 1,19 |
| Türkei | 0,23 | 0,25 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 1,45 | 1,50 |
| Großbritannien | 12,28 | 12,05 |
| Vereinigte Staaten | 57,71 | 59,96 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,13 | 5,44 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 2,28 | 0,26 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,08) | (0,50) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | 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 | 0,17 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,06 | (0,03) |
| Zinsswaps — Basisswaps | 0,00 | 0,01 |
| Zinsswaps | (0,86) | (0,07) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | 0,00 | 0,02 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,01) |
| Devisenoptionen | (0,01) | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | (0,07) | (0,08) |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,01 | (0,06) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | 0,01 |
| Cross-Currency Swaps | 0,00 | 0,08 |
| Zinsswaps | 0,07 | (0,01) |
| Total Return Swaps auf Indizes | (0,07) | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | 0,38 | 0,13 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,77 | (0,04) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (41,51) | (40,62) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Advantage Real Return Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | ARS | 519 | $ 11 | 0,01 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 7.864 | 181 | 0,24 |
| Summe Argentinien | | | 192 | 0,25 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027 | AUD | 1.139 | 853 | 1,10 |
| 1,250 % fällig am 21.02.2022 | | 3.439 | 2.507 | 3,25 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2025 | | 1.222 | 1.025 | 1,33 |
| Summe Australien | | | 4.385 | 5,68 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,999 % fällig am 27.01.2028 | $ | 283 | 301 | 0,39 |
| 7,375 % fällig am 17.01.2027 | | 150 | 172 | 0,22 |
| Summe Brasilien | | | 473 | 0,61 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 100 | 100 | 0,13 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.12.2047 (b) | CAD | 1.338 | 1.287 | 1,67 |
| 2,000 % fällig am 01.12.2041 (b) | | 245 | 254 | 0,33 |
| | | | 1.541 | 2,00 |
| Summe Kanada | | | 1.641 | 2,13 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Sudbury Mill CLO Ltd.** | | | | |
| 3,738 % fällig am 17.01.2026 | $ | 336 | 336 | 0,43 |
| **Symphony CLO Ltd.** | | | | |
| 3,627 % fällig am 15.10.2025 | | 407 | 408 | 0,53 |
| Summe Cayman Inseln | | | 744 | 0,96 |
| **CHILE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.03.2026 | CLP | 306.814 | 481 | 0,62 |
| 3,000 % fällig am 01.01.2044 | | 390.490 | 825 | 1,07 |
| **Bonos del Banco Central de Chile en UF** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.03.2022 | | 1.004.118 | 1.586 | 2,06 |
| Summe Chile | | | 2.892 | 3,75 |
| **KOLUMBIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Colombian TES** | | | | |
| 3,000 % fällig am 25.03.2033 | COP | 2.212.183 | 675 | 0,88 |
| 3,500 % fällig am 07.05.2025 | | 1.371.714 | 457 | 0,59 |
| Summe Kolumbien | | | 1.132 | 1,47 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 8.100 | 1.255 | 1,63 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 51 | 8 | 0,01 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 300 | 45 | 0,06 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 8 | 1 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 3.200 | $ 482 | 0,62 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 2.700 | 419 | 0,54 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 76 | 12 | 0,02 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | | 56 | 9 | 0,01 |
| | | | 2.231 | 2,89 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Denmark Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (b) | | 3.650 | 600 | 0,78 |
| Summe Dänemark | | | 2.831 | 3,67 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 (b) | € | 208 | 253 | 0,33 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2028 (b) | | 353 | 438 | 0,57 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2036 (b) | | 751 | 959 | 1,24 |
| 1,300 % fällig am 25.07.2019 (b) | | 100 | 113 | 0,15 |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 (b) | | 359 | 622 | 0,80 |
| 1,850 % fällig am 25.07.2027 (b) | | 482 | 687 | 0,89 |
| 2,100 % fällig am 25.07.2023 (b) | | 684 | 889 | 1,15 |
| 4,750 % fällig am 25.04.2035 (d) | | 900 | 1.720 | 2,23 |
| Summe Frankreich | | | 5.681 | 7,36 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | $ | 700 | 710 | 0,92 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bundesrepublik Germany** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2046 (b) | € | 87 | 129 | 0,17 |
| Summe Deutschland | | | 839 | 1,09 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSE** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | $ | 350 | 363 | 0,47 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Arbour CLO DAC** | | | | |
| 0,580 % fällig am 15.03.2029 | € | 180 | 204 | 0,26 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 26.04.2029 | | 100 | 114 | 0,15 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | | 270 | 307 | 0,40 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 200 | 228 | 0,29 |
| **Orwell Park CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,780 % fällig am 18.07.2029 | | 100 | 114 | 0,15 |
| **Tymon Park CLO Ltd.** | | | | |
| 0,590 % fällig am 21.01.2029 | | 100 | 114 | 0,15 |
| | | | 1.081 | 1,40 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | $ | 100 | 103 | 0,14 |
| **AKTIEN** | | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (c)** | | 1.000 | 102 | 0,13 |
| Summe Irland | | | 1.286 | 1,67 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 30.05.2036 | ILS | 1.129 | $ 485 | 0,63 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 500 | 572 | 0,74 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.05.2023 (b) | € | 814 | 907 | 1,18 |
| 0,450 % fällig am 22.05.2023 (b) | | 401 | 447 | 0,58 |
| 1,650 % fällig am 23.04.2020 (b) | | 100 | 116 | 0,15 |
| | | | 1.470 | 1,91 |
| Summe Italien | | | 2.042 | 2,65 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | $ | 500 | 501 | 0,65 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.09.2024 (b) | ¥ | 883.050 | 8.442 | 10,94 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (b) | | 10.099 | 98 | 0,13 |
| | | | 8.540 | 11,07 |
| Summe Japan | | | 9.041 | 11,72 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Delos Finance SARL** | | | | |
| 4,080 % fällig am 06.10.2023 | $ | 83 | 83 | 0,11 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2040 (b) | MXN | 25.034 | 1.392 | 1,80 |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 (b) | | 30.668 | 1.695 | 2,20 |
| 4,500 % fällig am 22.11.2035 (b) | | 36.404 | 2.142 | 2,78 |
| Summe Mexiko | | | 5.229 | 6,78 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | € | 300 | 342 | 0,44 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | | 100 | 114 | 0,15 |
| | | | 456 | 0,59 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 2,820 % fällig am 19.01.2022 | $ | 400 | 404 | 0,52 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | | 300 | 306 | 0,40 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 2,800 % fällig am 21.07.2023 | | 400 | 347 | 0,45 |
| | | | 1.057 | 1,37 |
| Summe Niederlande | | | 1.513 | 1,96 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | NZD | 790 | 580 | 0,75 |
| 2,500 % fällig am 20.09.2035 | | 845 | 719 | 0,93 |
| Summe Neuseeland | | | 1.299 | 1,68 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 300 | 100 | 0,13 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | PEN | 1.200 | $ | 401 | 0,52 |
| Summe Peru | | | | 501 | 0,65 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 28.02.2033 (b) | ZAR | 13.137 | | 784 | 1,02 |
| 2,000 % fällig am 31.01.2025 (b) | | 25.016 | | 1.686 | 2,18 |
| 2,750 % fällig am 31.01.2022 (b) | | 9.837 | | 702 | 0,91 |
| 5,500 % fällig am 07.12.2023 (b) | | 6.927 | | 545 | 0,71 |
| Summe Südafrika | | | | 3.717 | 4,82 |
| **SÜDKOREA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Korea Treasury Bond Inflation Linked** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 10.06.2023 | KRW | 2.929.663 | | 2.644 | 3,42 |
| **SPANIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Spain Government International Bond** | | | | | |
| 0,150 % fällig am 30.11.2023 (b) | € | 1.849 | | 2.207 | 2,86 |
| 0,650 % fällig am 30.11.2027 (b)(d) | | 1.668 | | 2.116 | 2,74 |
| Summe Spanien | | | | 4.323 | 5,60 |
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Sweden Government International Bond** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 01.06.2032 | SEK | 3.762 | | 511 | 0,66 |
| 0,250 % fällig am 01.06.2022 | | 2.682 | | 313 | 0,41 |
| Summe Schweden | | | | 824 | 1,07 |
| **TÜRKEI** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Turkey Government International Bond** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 08.11.2023 (b) | TRY | 26.183 | | 4.306 | 5,58 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 400 | | 511 | 0,66 |
| **AKTIEN** | | | | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 10,250 % | | 750 | | 145 | 0,19 |
| | | **PARI (000S)** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2026 (b)(d) | £ | 692 | | 1.051 | 1,36 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2028 (b) | | 124 | | 199 | 0,26 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2046 (b) | | 207 | | 443 | 0,57 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2048 (b) | £ | 58 | $ | 130 | 0,17 |
| 0,125 % fällig am 22.11.2056 (b) | | 11 | | 28 | 0,04 |
| 0,375 % fällig am 22.03.2062 (b) | | 98 | | 292 | 0,38 |
| 0,750 % fällig am 22.11.2047 (b) | | 208 | | 523 | 0,68 |
| 1,875 % fällig am 22.11.2022 (b)(d) | | 1.317 | | 1.951 | 2,53 |
| 2,500 % fällig am 16.04.2020 | | 3.676 | | 4.849 | 6,28 |
| | | | | 9.466 | 12,27 |
| Summe Großbritannien | | | | 10.122 | 13,12 |
| **USA** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 3,780 % fällig am 25.10.2037 | $ | 302 | | 306 | 0,40 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | | |
| 2,864 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 300 | | 286 | 0,37 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | | |
| 3,139 % fällig am 25.07.2035 | | 300 | | 301 | 0,39 |
| **GSAMP Trust** | | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.06.2036 | | 486 | | 479 | 0,62 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,914 % fällig am 25.05.2035 | | 1.300 | | 1.260 | 1,63 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | | |
| 2,824 % fällig am 25.12.2035 | | 600 | | 602 | 0,78 |
| | | | | 3.234 | 4,19 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | | |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | | 100 | | 100 | 0,13 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 300 | | 303 | 0,39 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | | |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | | 100 | | 100 | 0,13 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | | 100 | | 100 | 0,13 |
| **eBay, Inc.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2023 | | 100 | | 101 | 0,13 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | | |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | | 170 | | 170 | 0,22 |
| **Sempra Energy** | | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 100 | | 100 | 0,13 |
| | | | | 974 | 1,26 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,630 % fällig am 25.06.2047 | | 209 | | 211 | 0,28 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 3,044 % fällig am 25.07.2045 | | 10 | | 9 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,526 % fällig am 25.06.2036 | | 100 | | 103 | 0,13 |
| **MortgageIT Trust** | | | | | |
| 3,409 % fällig am 25.12.2034 | | 197 | | 197 | 0,26 |
| | | | | 520 | 0,68 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | $ 7.660 | $ | 7.831 | 10,15 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | | 5.500 | | 5.683 | 7,37 |
| **Ginnie Mae** | | | | | |
| 2,783 % fällig am 20.02.2049 | | 493 | | 493 | 0,64 |
| 3,030 % fällig am 20.08.2068 | | 201 | | 197 | 0,25 |
| | | | | 14.204 | 18,41 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2021 | | 431 | | 427 | 0,55 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2023 (d) | | 279 | | 277 | 0,36 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 (d) | | 1.812 | | 1.801 | 2,33 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 (e) | | 3.120 | | 3.143 | 4,07 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 (d) | | 1.201 | | 1.213 | 1,57 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 (d) | | 984 | | 1.001 | 1,30 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 (d) | | 742 | | 760 | 0,99 |
| 0,625 % fällig am 15.02.2043 | | 111 | | 108 | 0,14 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 (d) | | 1.069 | | 1.114 | 1,44 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 (d) | | 1.018 | | 1.023 | 1,33 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | | 158 | | 166 | 0,22 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | | 259 | | 273 | 0,35 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049 | | 274 | | 290 | 0,38 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 230 | | 262 | 0,34 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 (d) | | 1.040 | | 1.332 | 1,73 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | | 875 | | 1.128 | 1,46 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 (d) | | 1.856 | | 2.234 | 2,90 |
| 3,625 % fällig am 15.04.2028 | | 506 | | 649 | 0,84 |
| | | | | 17.201 | 22,30 |
| Summe USA | | | | 36.133 | 46,84 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | | |
| **Broadcom, Inc.** | | | | | |
| 2,870 % fällig am 16.07.2019 | | 250 | | 250 | 0,33 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 17.07.2019 | | 250 | | 249 | 0,32 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | | |
| 3,040 % fällig am 08.07.2019 | | 250 | | 250 | 0,32 |
| | | | | 749 | 0,97 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (f)** | | | | | |
| | | | | 462 | 0,60 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | | 1.211 | 1,57 |
| **AKTIEN** | | | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)** | | 103.390 | | 1.035 | 1,34 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$** | **106.967** | **138,65** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 3 | $ (4) | (0,01) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 113,800 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 160 | 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 113,900 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 19 | 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 134,500 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 11 | 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 4 | (10) | (0,01) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 4 | (8) | (0,01) |

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

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 178,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 45 | $ 0 | 0,00 |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09/2019 | 9 | (1) | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 64 | 135 | 0,17 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 5 | (7) | (0,01) |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 44 | (164) | (0,21) |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09/2019 | 155 | (39) | (0,05) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 112,100 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 34 | 2 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 129,750 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 8 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 155,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 63 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 4 | 4 | 0,01 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 4 | 4 | 0,01 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 2 | (4) | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 9 | (20) | (0,03) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 79 | 100 | 0,13 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 10 | (53) | (0,07) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09/2019 | 11 | (23) | (0,03) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 18 | 24 | 0,03 |
| | | | | $ (64) | (0,08) |

[1] Future-Style-Option.

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | $ 111,500 | 23.08.2019 | 3 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,000 | 23.08.2019 | 22 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,500 | 23.08.2019 | 15 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 113,500 | 23.08.2019 | 8 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 114,500 | 23.08.2019 | 10 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 230,000 | 23.08.2019 | 4 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 109,750 | 23.08.2019 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 193,000 | 23.08.2019 | 7 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 200,000 | 23.08.2019 | 3 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,250 | 23.08.2019 | 22 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,500 | 23.08.2019 | 3 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ 0 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 129,000 | 26.07.2019 | 4 | $(1) | $ (1) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (65)** | **(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-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Ally Financial, Inc. | 5,000 % | 20.06.2022 | $ 400 | $ (6) | (0,01) |
| Daimler AG | 1,000 | 20.12.2020 | € 40 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ (6) | (0,01) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,945 % | 02.01.2025 | BRL 14.300 | $ 431 | 0,56 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,970 | 02.01.2025 | 49.300 | 1.449 | 1,88 |
| Erhalt | 3-Month NZD-BBR | 3,250 | 21.03.2028 | NZD 1.000 | (94) | (0,12) |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,843 | 24.02.2025 | $ 2.450 | 13 | 0,01 |

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,850 % | 20.07.2026 | $ 5.900 | $ (211) | (0,28) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 1,850 | 27.07.2026 | 1.350 | (49) | (0,06) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 27.07.2026 | 3.900 | (138) | (0,18) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 1.500 | (126) | (0,16) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 27.04.2026 | 3.840 | (144) | (0,19) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,400 | 07.12.2026 | 700 | (24) | (0,03) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 3,100 | 17.04.2028 | 940 | (41) | (0,05) |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | € 600 | 14 | 0,02 |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.09.2021 | £ 5.190 | (41) | (0,05) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 20.09.2027 | ¥ 184.990 | (46) | (0,06) |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,066 | 15.02.2024 | € 1.640 | 16 | 0,02 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,167 | 15.03.2024 | 700 | 6 | 0,01 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,232 | 15.12.2023 | 1.800 | (39) | (0,05) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,323 | 15.03.2029 | 2.400 | (47) | (0,06) |
| Erhalt | CPURNSA | 1,954 | 03.06.2029 | $ 450 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,550 | 26.07.2021 | 700 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 1,603 | 12.09.2021 | 620 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 1,678 | 24.05.2021 | 3.200 | (6) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 1,845 | 24.05.2026 | 500 | 6 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,102 | 20.07.2027 | 400 | 7 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,122 | 01.08.2027 | 1.200 | 23 | 0,03 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,150 | 25.09.2027 | 200 | 4 | 0,01 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,210 | 05.02.2023 | 1.240 | (24) | (0,03) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,263 | 27.04.2023 | 180 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,263 | 09.05.2023 | 380 | (10) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,281 | 10.05.2023 | 570 | (16) | (0,02) |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,030 | 15.03.2024 | € 700 | (7) | (0,01) |
| Erhalt | FRCPXTOB | 1,345 | 15.06.2021 | 1.120 | (17) | (0,02) |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,590 | 15.02.2028 | 250 | 18 | 0,02 |
| Erhalt | UKRPI | 3,350 | 15.05.2030 | £ 870 | (7) | (0,01) |
| Erhalt | UKRPI | 3,500 | 15.09.2033 | 150 | (3) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,579 | 15.10.2033 | 50 | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ 884 | 1,15 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 878** | **1,14** |

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Kauf | 1,650 % | 21.08.2019 | 2.200 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |

**OPTIONEN AUF WERTPAPIERE**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FAR | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | $ 73,000 | 08.07.2019 | 2.600 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| JPM | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 70,000 | 08.07.2019 | 2.800 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 71,000 | 08.07.2019 | 4.500 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 0 | $ 0 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 200 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 % | 18.09.2019 | 100 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 200 | (1) | 0 | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (5) | $ 0 | 0,00 |

**INFLATION-CAPPED OPTIONS**

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Cap - OTC CPALEMU | $ 100,151 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035 | 2.400 | $ (109) | $ (4) | (0,01) |
| JPM | Cap - OTC CPURNSA | 233,916 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0 | 22.04.2024 | 7.500 | (55) | 0 | 0,00 |
| | Cap - OTC CPURNSA | 234,781 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0 | 16.05.2024 | 700 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Floor - OTC YOY CPURNSA | 234,812 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 24.03.2020 | 10.900 | (123) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (292) | $ (4) | (0,01) |

**ZINSCAPS**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2] | 10-Year USD-ISDA-2-Year USD-ISDA | 0,000 % | 02.01.2020 | 7.000 | $ (5) | $ (1) | 0,00 |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

[2] Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Mexico Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 100 | $ 1 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| BPS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 100 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 500 | 4 | (4) | 0 | 0,00 |
| HUS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 200 | 2 | (2) | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 8 | $ (8) | $ 0 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 % | 17.01.2047 | $ 717 | $ (22) | $ 29 | $ 7 | 0,01 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 500 | (23) | 29 | 6 | 0,01 |
| GST | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 1.100 | (57) | 70 | 13 | 0,01 |
| MEI | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 1.800 | (94) | 115 | 21 | 0,03 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 | 17.01.2047 | 577 | (18) | 24 | 6 | 0,01 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ (214) | $ 267 | $ 53 | 0,07 |

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

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

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

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,963 % | 16.02.2028 | ILS 340 | $ 0 | $ 6 | $ 6 | 0,01 |
| BRC | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,374) | 20.06.2020 | 850 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,950 | 20.06.2028 | 180 | 0 | 2 | 3 | 0,00 |
| DUB | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 2,100 | 20.06.2028 | 180 | 0 | 3 | 3 | 0,01 |
| | Zahlung | CPURNSA | 2,500 | 15.07.2022 | $ 500 | 4 | (57) | (53) | (0,07) |
| GLM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | ILS 670 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,290) | 16.02.2020 | 1.610 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,270) | 21.03.2020 | 1.000 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,883 | 21.03.2028 | 210 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 140 | 0 | 2 | 2 | 0,00 |
| JPM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,420) | 20.06.2020 | 820 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYC | Erhalt | CPURNSA | (1,805) | 20.09.2026 | $ 200 | 0 | (3) | (4) | 0,00 |
| | | | | | | $ 4 | $ (44) | $ (40) | (0,05) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CLP | 1.821.449 | $ | 2.684 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.862 | AUD | 4.098 | 14 | 0 | 14 | 0,02 |
| | 08/2019 | AUD | 4.098 | $ | 2.865 | 0 | (14) | (14) | (0,02) |
| | 08/2019 | € | 2.295 | | 2.600 | 0 | (23) | (23) | (0,03) |
| | 09/2019 | $ | 1.410 | ILS | 5.021 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | BRL | 33.858 | $ | 8.852 | 18 | 0 | 18 | 0,02 |
| | 07/2019 | TRY | 3.219 | | 556 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 19 | ARS | 946 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.950 | £ | 3.903 | 17 | 0 | 17 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 1.051 | NZD | 1.576 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 792 | TRY | 4.627 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 3.903 | $ | 4.958 | 0 | (17) | (17) | (0,02) |
| | 08/2019 | NZD | 1.576 | | 1.052 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 4 | ARS | 182 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 8.826 | BRL | 33.858 | 0 | (16) | (16) | (0,02) |
| | 08/2019 | | 382 | RUB | 24.918 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| | 09/2019 | KRW | 1.595.835 | $ | 1.346 | 0 | (36) | (36) | (0,05) |
| | 10/2019 | DKK | 2.975 | | 457 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | | 6.325 | | 953 | 0 | (12) | (12) | (0,02) |
| | 07/2019 | ¥ | 29.800 | | 272 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| CBK | 07/2019 | AUD | 4.098 | | 2.837 | 0 | (38) | (38) | (0,05) |
| | 07/2019 | CLP | 60.194 | | 85 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 4.320 | | 657 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 398.200 | | 3.655 | 0 | (41) | (41) | (0,05) |
| | 07/2019 | $ | 1.085 | COP | 3.654.931 | 54 | 0 | 54 | 0,07 |
| | 07/2019 | | 1.867 | DKK | 12.276 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| | 08/2019 | CAD | 146 | $ | 108 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 2.536 | | 2.849 | 0 | (49) | (49) | (0,06) |
| | 08/2019 | PEN | 387 | | 115 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 453 | CAD | 607 | 12 | 0 | 12 | 0,02 |
| | 08/2019 | | 2.074 | € | 1.826 | 13 | 0 | 13 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 120 | CNY | 833 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 12.276 | $ | 1.881 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 10/2019 | PEN | 1.337 | | 396 | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| | 10/2019 | $ | 1.825 | MXN | 35.797 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | | 1.492 | CLP | 1.012.521 | 2 | (2) | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 96 | COP | 313.381 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.084 | MXN | 41.370 | 54 | 0 | 54 | 0,07 |
| | 09/2019 | CLP | 965.022 | $ | 1.424 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 370 | IDR | 5.426.750 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| | 10/2019 | MXN | 53.967 | $ | 2.711 | 4 | (55) | (51) | (0,07) |
| HUS | 07/2019 | € | 22 | | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 14 | ARS | 697 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 559 | BRL | 2.168 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.275 | CLP | 869.122 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| | 09/2019 | KRW | 83.032 | $ | 70 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 255 | | 187 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 55 | KRW | 64.584 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 6.742 | $ | 215 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| IND | 07/2019 | SEK | 1.755 | | 183 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | BRL | 2.720 | | 679 | 0 | (31) | (31) | (0,04) |
| | 07/2019 | DKK | 1.680 | | 255 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.043 | £ | 1.621 | 20 | 0 | 20 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 205 | ¥ | 22.200 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 98 | ZAR | 1.457 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| | 07/2019 | ZAR | 23.483 | $ | 1.613 | 0 | (53) | (53) | (0,07) |
| | 08/2019 | $ | 105 | MXN | 2.033 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | COP | 802.599 | $ | 238 | 0 | (11) | (11) | (0,01) |
| | 11/2019 | TWD | 2.167 | | 69 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | NZD | 1.576 | | 1.029 | 0 | (30) | (30) | (0,04) |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | ZAR | 1.712 | $ | 115 | $ 0 | $ (6) | $ (6) | (0,01) |
| RBC | 07/2019 | COP | 3.968.312 | | 1.248 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| | 09/2019 | $ | 1.243 | COP | 3.968.312 | 0 | (12)) | (12) | (0,02) |
| RYL | 07/2019 | BRL | 7.937 | $ | 2.071 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.065 | BRL | 7.937 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 5.524 | $ | 6.992 | 0 | (39) | (39) | (0,05) |
| | 07/2019 | $ | 10.506 | BRL | 42.347 | 544 | 0 | 544 | 0,70 |
| | 07/2019 | | 715 | TRY | 4.245 | 19 | 0 | 19 | 0,02 |
| | 11/2019 | TWD | 2.703 | $ | 86 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SSB | 08/2019 | $ | 94 | CAD | 125 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| TOR | 08/2019 | | 288 | MXN | 5.579 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 3.770 | ¥ | 405.800 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 405.800 | $ | 3.779 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 5.347 | € | 4.726 | 53 | 0 | 53 | 0,07 |
| | 09/2019 | CNH | 837 | $ | 121 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 918 | $ (546) | $ 372 | 0,48 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | £ | 4 | $ | 5 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 200 | AUD | 286 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 251 | CAD | 331 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.077 | CHF | 3.087 | 89 | 0 | 89 | 0,11 |
| | 08/2019 | AUD | 286 | $ | 200 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 331 | | 252 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | $ | 392 | £ | 309 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 309 | $ | 393 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 286 | | 198 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 2.132 | | 2.177 | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 43 | | 50 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 64.703 | | 594 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 1.569 | € | 1.380 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 1.380 | $ | 1.573 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.183 | CHF | 2.132 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | | 2.178 | | 2.192 | 70 | 0 | 70 | 0,09 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 331 | $ | 245 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 07/2019 | CHF | 3.222 | | 3.298 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 3.308 | CHF | 3.222 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| IND | 07/2019 | SEK | 724 | $ | 76 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | € | 1.318 | | 1.473 | 0 | (27) | (27) | (0,04) |
| SCX | 07/2019 | | 19 | | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 305 | | 386 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 78 | SEK | 724 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 724 | $ | 78 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | DKK | 299 | | 45 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 37 | | 24 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 76 | CHF | 75 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 601 | ¥ | 64.703 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 64.703 | $ | 603 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 185 | $ (75) | $ 110 | 0,14 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Partially Hedged) ausschüttend, E Class EUR (Partially Hedged) thesaurierend und G Institutional EUR (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 1.904 | $ | 2.164 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 746 | AUD | 1.068 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 841 | CAD | 1.107 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| | 08/2019 | AUD | 1.068 | $ | 747 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 08/2019 | CAD | 1.107 | | 842 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 2.169 | € | 1.904 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | € | 37 | $ | 41 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 105 | | 134 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 104 | CAD | 140 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 68 | € | 60 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.382 | £ | 1.090 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| | 08/2019 | £ | 1.090 | $ | 1.384 | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| BRC | 07/2019 | $ | 39 | DKK | 260 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.718 | € | 3.324 | 68 | 0 | 68 | 0,09 |
| | 07/2019 | | 274 | ¥ | 29.952 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 1.099 | $ | 761 | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| | 07/2019 | CAD | 106 | | 80 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | € 10.413 | $ 11.835 | $ 0 | $ (24) | $ (24) | (0,03) |
| | 07/2019 | ¥ 244.774 | 2.247 | 0 | (25) | (25) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ 11 | € 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | 11.856 | 10.406 | 24 | 0 | 24 | 0,03 |
| GLM | 07/2019 | € 1.521 | $ 1.697 | 0 | (35) | (35) | (0,05) |
| | 07/2019 | $ 1.338 | € 1.180 | 6 | 0 | 6 | 0,01 |
| | 07/2019 | 39 | SEK 369 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD 1.141 | $ 846 | 0 | (26) | (26) | (0,03) |
| IND | 07/2019 | SEK 3.014 | 314 | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| MYI | 07/2019 | $ 93 | AUD 134 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | DKK 1.687 | $ 256 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | AUD 103 | 72 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ 1.123 | 1.421 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 242 | € 214 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | 285 | SEK 2.645 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK 2.645 | $ 286 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | NZD 144 | 95 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 174 | £ 138 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | ¥ 22.884 | $ 211 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 10.161 | € 9.087 | 186 | 0 | 186 | 0,24 |
| UAG | 07/2019 | 24 | DKK 156 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | 2.208 | ¥ 237.706 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ 237.706 | $ 2.214 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | $ 320 | $ (168) | $ 152 | 0,20 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | £ 14 | $ 18 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 110 | AUD 157 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | 146 | CAD 192 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | 2 | £ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD 157 | $ 110 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD 192 | 146 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 1.532 | 1.943 | 0 | (7) | (7) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 7 | € 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | 1.924 | £ 1.515 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | AUD 157 | $ 109 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ 778 | 989 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ 39.391 | 362 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 935 | € 823 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | 1.009 | £ 796 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 08/2019 | € 817 | $ 930 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 991 | £ 778 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | 65 | 51 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD 192 | $ 142 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ 8 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 6 | £ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | SEK 482 | $ 50 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | € 829 | 926 | 0 | (17) | (17) | (0,02) |
| SCX | 07/2019 | $ 1.871 | £ 1.479 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| | 07/2019 | 52 | SEK 482 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK 482 | $ 52 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | NZD 28 | 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | $ 366 | ¥ 39.391 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ 39.391 | $ 367 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 27 | $ (41) | $ (14) | (0,02) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 628** | **0,81** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 2.100 | $ (2.116) | (2,74) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (2.116)** | **(2,74)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 106.292** | **137,78** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (29.145)** | **(37,78)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 77.147** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(c) Mit dem Fonds verbunden.**

**(d) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 16.048 als Sicherheiten verpfändet.**

**(e) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.090 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 338 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 1.530 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von EUR 10 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(f) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 1,350 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 462 | U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021 | $ (475) | $ 462 | $ 462 | 0,60 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (475)** | **$ 462** | **$ 462** | **0,60** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.137 | $ 105.830 | $ 0 | $ 106.967 |
| Finanzderivate[3] | (65) | 1.506 | 0 | 1.441 |
| Leerverkäufe | 0 | (2.116) | 0 | (2.116) |
| **Summen** | **$ 1.072** | **$ 105.220** | **$ 0** | **$ 106.292** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 431 | $ 127.570 | $ 0 | $ 128.001 |
| Finanzderivate[3] | (401) | 447 | 0 | 46 |
| Leerverkäufe | 0 | (1.072) | 0 | (1.072) |
| **Summen** | **$ 30** | **$ 126.945** | **$ 0** | **$ 126.975** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (0,300) % | 17.04.2019 | 18.07.2019 | € (1.152) | $ (1.311) | (1,70) |
| | 0,830 | 31.05.2019 | 09.08.2019 | £ (661) | (842) | (1,09) |
| | 0,850 | 31.05.2019 | 09.08.2019 | (975) | (1.241) | (1,61) |
| IND | 2,600 | 25.06.2019 | 25.07.2019 | $ (1.123) | (1.123) | (1,46) |
| | 2,620 | 19.06.2019 | 12.07.2019 | (2.061) | (2.063) | (2,67) |
| SCX | (0,300) | 06.06.2019 | 18.07.2019 | € (1.800) | (2.050) | (2,66) |
| | 2,600 | 17.04.2019 | 17.07.2019 | $ (3.557) | (3.576) | (4,64) |
| | 2,600 | 24.04.2019 | 24.07.2019 | (1.070) | (1.075) | (1,39) |
| | 2,600 | 27.06.2019 | 24.07.2019 | (2.172) | (2.183) | (2,83) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (15.464)** | **(20,05)** |

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkaufgeschäfte[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPG | 2,580 % | 13.06.2019 | 25.07.2019 | $ (3.063) | $ (3.067) | (3,98) |
| **Summe Rückkaufgeschäfte** | | | | | **$ (3.067)** | **(3,98)** |

[1] In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 5 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 76 | $ 0 | $ 76 |
| BPS | (14) | 0 | (14) |
| BRC | 60 | 0 | 60 |
| CBK | (109) | 0 | (109) |
| DUB | (37) | (10) | (47) |
| GLM | 61 | (260) | (199) |
| GST | 13 | 0 | 13 |
| HUS | (30) | 10 | (20) |
| IND | (20) | 0 | (20) |
| JPM | (72) | 0 | (72) |
| MEI | 21 | 0 | 21 |
| MYC | 1 | 0 | 1 |
| MYI | (79) | 0 | (79) |
| RBC | (1) | 0 | (1) |
| RYL | (2) | (10) | (12) |
| SCX | 524 | (390) | 134 |
| SSB | (1) | 0 | (1) |
| TOR | 185 | 0 | 185 |
| UAG | 52 | 0 | 52 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 105,33 | 96,42 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 32,72 | 42,29 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,60 | 6,99 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,08) | (0,46) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 1,14 | 0,32 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,81 | 0,19 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,74) | (1,22) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (20,05) | (31,02) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (3,98) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,25 | 0,48 |
| Australien | 5,68 | 4,82 |
| Brasilien | 0,61 | 0,48 |
| Kanada | 2,13 | 1,60 |
| Cayman-Inseln | 0,96 | 0,99 |
| Chile | 3,75 | 4,62 |
| Kolumbien | 1,47 | 2,44 |
| Dänemark | 3,67 | 0,71 |
| Frankreich | 7,36 | 6,59 |
| Deutschland | 1,09 | 1,36 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,47 | 0,68 |
| Irland | 1,67 | 1,46 |
| Israel | 0,63 | 1,57 |
| Italien | 2,65 | 4,99 |
| Japan | 11,72 | 9,95 |
| Luxemburg | 0,11 | 0,11 |
| Mexiko | 6,78 | 7,19 |
| Niederlande | 1,96 | 0,85 |
| Neuseeland | 1,68 | 1,63 |
| Peru | 0,65 | 0,52 |
| Südafrika | 4,82 | 4,15 |
| Südkorea | 3,42 | 3,09 |
| Spanien | 5,60 | 2,55 |
| Schweden | 1,07 | 0,93 |
| Schweiz | 0,00 | 0,57 |
| Türkei | 5,58 | 6,73 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Großbritannien | 13,12 | 13,62 |
| Vereinigte Staaten | 46,84 | 50,11 |
| Kurzfristige Instrumente | 1,57 | 10,53 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 1,34 | 0,38 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,08) | (0,44) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | (0,02) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | 0,04 |
| Zinsswaps | 1,15 | 0,29 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,01) |
| Inflation-Capped Options | (0,01) | (0,02) |
| Zinscaps | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,07 | 0,02 |
| Zinsswaps | (0,05) | (0,06) |
| Devisenterminkontrakte | 0,48 | 0,25 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,32 | 0,02 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,74) | (1,22) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (37,78) | (44,53) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **HSBC Bank Argentina S.A.** | | | | |
| 25,250 % fällig am 27.09.2019 | ARS | 52.085 | $ 1.117 | 0,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | € | 4.200 | 3.746 | 0,03 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | ARS | 172.970 | 3.514 | 0,02 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 382.090 | 8.800 | 0,06 |
| | | | 16.060 | 0,11 |
| Summe Argentinien | | | 17.177 | 0,12 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Driver Australien Four Trust** | | | | |
| 2,185 % fällig am 21.08.2025 | AUD | 2.966 | 2.082 | 0,01 |
| **Boral Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.11.2022 | $ | 500 | 500 | 0,00 |
| **Commonwealth Bank of Australia** | | | | |
| 3,000 % fällig am 04.09.2026 | £ | 11.400 | 16.099 | 0,12 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.03.2021 | $ | 100 | 100 | 0,00 |
| **Newcrest Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.11.2021 | | 900 | 934 | 0,01 |
| **Optus Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.10.2019 | | 3.109 | 3.131 | 0,02 |
| **Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 22.02.2021 | | 100 | 104 | 0,00 |
| **Volkswagen Financial Services Australia Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 22.06.2020 | AUD | 28.400 | 20.138 | 0,15 |
| **Westpac Banking Corp.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.03.2021 | € | 300 | 353 | 0,00 |
| | | | 41.359 | 0,30 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Interstar Millennium Trust** | | | | |
| 1,635 % fällig am 27.03.2038 | AUD | 16 | 11 | 0,00 |
| **Liberty Funding Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,220 % fällig am 10.06.2051 | | 19.700 | 13.825 | 0,10 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,511 % fällig am 16.09.2059 | | 19.086 | 13.354 | 0,10 |
| | | | 27.190 | 0,20 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **New South Wales Treasury Corp.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.11.2025 | | 393 | 320 | 0,00 |
| **Queensland Treasury Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 21.07.2025 | | 375 | 313 | 0,00 |
| | | | 633 | 0,00 |
| Summe Australien | | | 71.264 | 0,51 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Anheuser-Busch InBev S.A.** | | | | |
| 0,432 % fällig am 17.03.2020 | € | 100 | 115 | 0,00 |
| 2,250 % fällig am 24.05.2029 | £ | 7.700 | 9.765 | 0,07 |
| **Euroclear Bank S.A.** | | | | |
| 0,077 % fällig am 08.03.2021 | € | 700 | 800 | 0,01 |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (g)(i) | | 10.000 | 11.176 | 0,08 |
| | | | 21.856 | 0,16 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Belgium Government International Bond** | | | | |
| 1,600 % fällig am 22.06.2047 | € | 700 | $ 927 | 0,01 |
| 2,150 % fällig am 22.06.2066 | | 500 | 747 | 0,00 |
| | | | 1.674 | 0,01 |
| Summe Belgien | | | 23.530 | 0,17 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,299 % fällig am 27.01.2025 | $ | 1.700 | 1.808 | 0,01 |
| 5,999 % fällig am 27.01.2028 | | 30.350 | 32.308 | 0,23 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | | 12.100 | 13.280 | 0,10 |
| 7,375 % fällig am 17.01.2027 | | 20.300 | 23.264 | 0,17 |
| Summe Brasilien | | | 70.660 | 0,51 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of Montreal** | | | | |
| 0,200 % fällig am 26.01.2023 | € | 500 | 579 | 0,01 |
| 0,750 % fällig am 21.09.2022 | | 400 | 471 | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 15.06.2021 | $ | 17.800 | 17.713 | 0,13 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | |
| 1,875 % fällig am 26.04.2021 | | 35.100 | 34.991 | 0,25 |
| **Canadian Imperial Bank of Commerce** | | | | |
| 3,150 % fällig am 27.06.2021 | | 15.300 | 15.616 | 0,11 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 14.000 | 14.004 | 0,10 |
| 3,110 % fällig am 15.06.2020 | | 6.900 | 6.920 | 0,05 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 15.000 | 18.333 | 0,13 |
| **HSBC Bank Canada** | | | | |
| 3,300 % fällig am 28.11.2021 | $ | 25.100 | 25.856 | 0,19 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 2,300 % fällig am 22.03.2021 | | 22.400 | 22.516 | 0,16 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.03.2021 | | 200 | 201 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 18.01.2022 | | 42.100 | 42.602 | 0,31 |
| | | | 199.802 | 1,44 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 2,078 % fällig am 01.06.2020 | CAD | 5.664 | 4.335 | 0,03 |
| 2,278 % fällig am 01.07.2020 | | 14.877 | 11.410 | 0,08 |
| 2,278 % fällig am 01.08.2020 | | 5.310 | 4.070 | 0,03 |
| **Real Estate Asset Liquidity Trust** | | | | |
| 3,072 % fällig am 12.08.2053 | | 3.234 | 2.518 | 0,02 |
| 3,650 % fällig am 12.08.2053 | | 7.100 | 5.687 | 0,04 |
| | | | 28.020 | 0,20 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canada Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.06.2028 | | 650 | 520 | 0,00 |
| **Canada Housing Trust** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.12.2028 | | 525 | 429 | 0,00 |
| 3,150 % fällig am 15.09.2023 | | 400 | 324 | 0,00 |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (f) | | 9.293 | 9.124 | 0,07 |
| **CPPIB Capital, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.03.2033 | € | 2.900 | 3.740 | 0,03 |
| **Province of Alberta** | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.06.2020 | CAD | 34.000 | 25.897 | 0,19 |
| 3,350 % fällig am 01.11.2023 | $ | 4.500 | 4.752 | 0,03 |
| **Province of British Columbia** | | | | |
| 4,300 % fällig am 18.06.2042 | CAD | 100 | 102 | 0,00 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 0,375 % fällig am 14.06.2024 | € | 100 | 117 | 0,00 |
| 2,450 % fällig am 29.06.2022 | $ | 2.700 | 2.739 | 0,02 |
| 3,150 % fällig am 02.06.2022 | CAD | 58.000 | 46.208 | 0,33 |
| 4,000 % fällig am 07.10.2019 | $ | 300 | 301 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 03.12.2019 | € | 100 | 116 | 0,00 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 2,750 % fällig am 25.08.2021 | $ | 9.500 | 9.679 | 0,07 |
| 3,000 % fällig am 01.09.2023 | CAD | 17.000 | 13.654 | 0,10 |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 22.600 | 18.310 | 0,13 |
| 3,750 % fällig am 01.09.2024 | CAD | 500 | $ 419 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2021 | | 31.700 | 25.741 | 0,19 |
| 5,000 % fällig am 01.12.2038 | | 11.300 | 12.059 | 0,09 |
| | | | 174.231 | 1,25 |
| Summe Kanada | | | 402.053 | 2,89 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Apex Credit CLO Ltd.** | | | | |
| 3,632 % fällig am 27.10.2028 | $ | 8.800 | 8.811 | 0,06 |
| **Ares CLO Ltd.** | | | | |
| 3,778 % fällig am 17.04.2026 | | 7.599 | 7.602 | 0,05 |
| **Avery Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,680 % fällig am 25.04.2026 | | 3.973 | 3.975 | 0,03 |
| 3,721 % fällig am 18.01.2025 | | 5.312 | 5.317 | 0,04 |
| **B&M CLO Ltd.** | | | | |
| 3,331 % fällig am 16.04.2026 | | 5.390 | 5.385 | 0,04 |
| **Cent CLO Ltd.** | | | | |
| 3,667 % fällig am 15.10.2026 | | 10.550 | 10.551 | 0,08 |
| **Crown Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,713 % fällig am 17.07.2028 | | 3.300 | 3.285 | 0,02 |
| 3,762 % fällig am 20.10.2028 | | 8.100 | 8.084 | 0,06 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.10.2027 | | 22.900 | 22.872 | 0,16 |
| **Evans Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 3,441 % fällig am 28.05.2028 | | 6.500 | 6.465 | 0,05 |
| **Figueroa CLO Ltd.** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.01.2027 | | 9.547 | 9.540 | 0,07 |
| **Flagship Ltd.** | | | | |
| 3,712 % fällig am 20.01.2026 | | 978 | 978 | 0,01 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | |
| 3,642 % fällig am 21.01.2028 | | 14.300 | 14.287 | 0,10 |
| **Jamestown CLO Ltd.** | | | | |
| 3,287 % fällig am 15.07.2026 | | 3.145 | 3.137 | 0,02 |
| 3,467 % fällig am 15.01.2028 | | 19.000 | 18.942 | 0,14 |
| **JMP Credit Advisors CLO Ltd.** | | | | |
| 3,438 % fällig am 17.01.2028 | | 18.100 | 18.017 | 0,13 |
| **Mountain Hawk CLO Ltd.** | | | | |
| 3,801 % fällig am 18.04.2025 | | 14.827 | 14.829 | 0,11 |
| **Mountain View CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.10.2026 | | 2.575 | 2.565 | 0,02 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | | 2.700 | 2.695 | 0,02 |
| **OHA Credit Partners Ltd.** | | | | |
| 3,771 % fällig am 20.10.2025 | | 4.508 | 4.512 | 0,03 |
| **Seneca Park CLO Ltd.** | | | | |
| 3,708 % fällig am 17.07.2026 | | 8.928 | 8.938 | 0,06 |
| **Symphony CLO Ltd.** | | | | |
| 3,627 % fällig am 15.10.2025 | | 15.563 | 15.571 | 0,11 |
| **Telos CLO Ltd.** | | | | |
| 3,858 % fällig am 17.01.2027 | | 6.323 | 6.326 | 0,05 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 3,447 % fällig am 15.01.2028 | | 15.300 | 15.258 | 0,11 |
| 3,667 % fällig am 15.04.2027 | | 3.000 | 2.993 | 0,02 |
| **WhiteHorse Ltd.** | | | | |
| 3,518 % fällig am 17.04.2027 | | 5.600 | 5.591 | 0,04 |
| **Zais CLO Ltd.** | | | | |
| 3,747 % fällig am 15.04.2028 | | 19.400 | 19.441 | 0,14 |
| | | | 245.967 | 1,77 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ambac LSNI LLC** | | | | |
| 7,319 % fällig am 12.02.2023 | | 629 | 640 | 0,01 |
| **Baidu, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 29.09.2023 | | 300 | 311 | 0,00 |
| **China Mengniu Dairy Co. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.08.2023 | | 9.100 | 9.532 | 0,07 |
| **KSA Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,894 % fällig am 20.04.2022 | | 7.700 | 7.796 | 0,06 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,576 % fällig am 02.05.2022 | | 15.700 | 15.818 | 0,11 |
| 3,872 % fällig am 31.05.2021 | | 7.050 | 7.147 | 0,05 |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 50.200 | 50.323 | 0,36 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 47.800 | 47.919 | 0,34 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | $ | 5.000 | $ 5.265 | 0,04 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 4.100 | 4.405 | 0,03 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 9.100 | 9.906 | 0,07 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 3.240 | 3.312 | 0,02 |
| 3,925 % fällig am 19.01.2038 | | 1.100 | 1.111 | 0,01 |
| | | | 163.485 | 1,17 |
| Summe Cayman Inseln | | | 409.452 | 2,94 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of China Ltd.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 17.04.2022 | € | 300 | 343 | 0,00 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 0,240 % fällig am 12.10.2020 | | 600 | 683 | 0,01 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 17.05.2022 | $ | 1.100 | 1.137 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 10.04.2024 | | 400 | 428 | 0,00 |
| | | | 2.591 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **China Development Bank** | | | | |
| 3,050 % fällig am 25.08.2026 | CNY | 95.700 | 13.298 | 0,10 |
| 3,180 % fällig am 05.04.2026 | | 282.900 | 39.773 | 0,29 |
| 3,680 % fällig am 26.02.2026 | | 398.700 | 57.837 | 0,42 |
| 3,740 % fällig am 10.09.2025 | | 70.700 | 10.304 | 0,07 |
| 4,040 % fällig am 10.04.2027 | | 203.700 | 30.065 | 0,22 |
| 4,040 % fällig am 06.07.2028 | | 49.300 | 7.290 | 0,05 |
| 4,150 % fällig am 26.10.2025 | | 51.300 | 7.642 | 0,06 |
| 4,240 % fällig am 24.08.2027 | | 356.200 | 53.313 | 0,38 |
| 4,880 % fällig am 09.02.2028 | | 401.900 | 62.896 | 0,45 |
| **China Government International Bond** | | | | |
| 2,740 % fällig am 04.08.2026 | | 12.400 | 1.740 | 0,01 |
| 2,950 % fällig am 16.06.2023 | | 32.900 | 4.794 | 0,03 |
| 3,220 % fällig am 06.12.2025 | | 32.800 | 4.765 | 0,03 |
| 3,290 % fällig am 18.10.2023 | | 98.600 | 14.520 | 0,10 |
| **Export-Import Bank of China** | | | | |
| 0,300 % fällig am 06.03.2022 | € | 400 | 460 | 0,00 |
| | | | 308.697 | 2,21 |
| Summe China | | | 311.288 | 2,23 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 62.242 | 9.858 | 0,07 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 369.200 | 57.509 | 0,41 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 156.266 | 24.642 | 0,18 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 71.012 | 11.168 | 0,08 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 104 | 17 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.01.2020 | | 1.400 | 215 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 13.290 | 2.103 | 0,02 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 178.592 | 27.703 | 0,20 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2020 | | 8.800 | 1.386 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 175.645 | 27.671 | 0,20 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 77.028 | 12.129 | 0,09 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2037 | | 7 | 1 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 175 | 28 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,156 % fällig am 01.10.2022 | € | 200 | 231 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.07.2019 | DKK | 4.200 | 641 | 0,01 |
| 1,000 % fällig am 01.01.2020 | | 1.600 | 246 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 01.07.2021 | | 1.500 | 237 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 89.577 | 14.187 | 0,10 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 735.237 | 114.452 | 0,82 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 479.754 | 75.689 | 0,54 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 13.632 | 2.146 | 0,02 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 1.863 | 301 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 1.466 | 235 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2047 | | 1 | 0 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 0,610 % fällig am 01.01.2038 | | 168 | 27 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 3.450 | 536 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 749.181 | 118.081 | 0,85 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 71.741 | 11.292 | 0,08 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2036 | | 161 | 26 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | DKK | 70 | $ 11 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2046 | | 6 | 1 | 0,00 |
| | | | 512.769 | 3,68 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Denmark Government International Bond** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.11.2021 | | 3.100 | 516 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.11.2039 | | 200 | 58 | 0,00 |
| | | | 574 | 0,01 |
| Summe Dänemark | | | 513.343 | 3,69 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN U. SCHULDVERSCHREIBUNGEN** | | | | |
| **Nordea Mortgage Bank PLC** | | | | |
| 0,625 % fällig am 23.05.2025 | € | 1.000 | 1.193 | 0,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Finnvera Oyj** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.09.2022 | | 6.000 | 7.085 | 0,05 |
| Summe Finnland | | | 8.278 | 0,06 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **FCT Ginkgo Compartment Sales Finance** | | | | |
| 0,002 % fällig am 25.11.2044 | | 643 | 734 | 0,01 |
| **FCT Titrisocram** | | | | |
| 0,082 % fällig am 25.11.2035 | | 15 | 17 | 0,00 |
| 0,082 % fällig am 25.07.2036 | | 270 | 309 | 0,00 |
| **Purple Master Credit Cards** | | | | |
| 0,052 % fällig am 25.10.2030 | | 33.400 | 38.190 | 0,27 |
| | | | 39.250 | 0,28 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | | 3.600 | 4.266 | 0,03 |
| 7,375 % fällig am 01.05.2026 | $ | 8.500 | 8.734 | 0,06 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 23.01.2026 | £ | 3.400 | 4.600 | 0,04 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 5,150 % fällig am 21.07.2024 | $ | 300 | 325 | 0,00 |
| **Credit Agricole Assurances S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 13.01.2025 (q) | € | 100 | 124 | 0,00 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 0,040 % fällig am 11.12.2019 | | 250 | 285 | 0,00 |
| 0,200 % fällig am 16.03.2021 | | 200 | 230 | 0,00 |
| 0,250 % fällig am 19.03.2020 | | 300 | 343 | 0,00 |
| 0,500 % fällig am 17.01.2025 | | 15.500 | 18.285 | 0,13 |
| 0,750 % fällig am 25.01.2023 | | 24.800 | 29.342 | 0,21 |
| 1,875 % fällig am 29.01.2020 | $ | 1.450 | 1.448 | 0,01 |
| 1,875 % fällig am 15.09.2021 | | 18.550 | 18.505 | 0,13 |
| 2,000 % fällig am 22.01.2021 | € | 21.200 | 25.084 | 0,18 |
| 2,250 % fällig am 18.02.2020 | $ | 7.800 | 7.798 | 0,06 |
| 2,375 % fällig am 20.09.2022 | | 11.800 | 11.923 | 0,09 |
| 3,250 % fällig am 26.09.2023 | | 6.900 | 7.227 | 0,05 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 22.01.2114 | | 850 | 987 | 0,01 |
| **HSBC France S.A.** | | | | |
| 0,200 % fällig am 04.09.2021 | € | 600 | 688 | 0,01 |
| **Pernod Ricard S.A.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.01.2022 | $ | 200 | 209 | 0,00 |
| **Teleperformance** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.07.2025 | € | 3.200 | 3.841 | 0,03 |
| **Total Capital International S.A.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 25.01.2023 | $ | 1.300 | 1.321 | 0,01 |
| | | | 145.565 | 1,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 25.05.2048 (k) | € | 71.881 | 105.417 | 0,75 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 | | 19.200 | 34.597 | 0,25 |
| **S.A. de Gestion de Stocks de Securite** | | | | |
| 1,750 % fällig am 22.10.2019 | | 900 | 1.032 | 0,01 |
| | | | 141.046 | 1,01 |
| Summe Frankreich | | | 325.861 | 2,34 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | |
| 0,012 % fällig am 20.06.2025 | € | 312 | $ 356 | 0,00 |
| **Driver Multi-Compartment S.A.** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.02.2026 | | 4.192 | 4.784 | 0,04 |
| 0,009 % fällig am 21.08.2026 | | 492 | 562 | 0,00 |
| **Red & Black Auto Germany UG** | | | | |
| 0,124 % fällig am 15.09.2025 | | 8.396 | 9.587 | 0,07 |
| **SC Germany Auto UG** | | | | |
| 0,023 % fällig am 13.12.2026 | | 81 | 93 | 0,00 |
| | | | 15.382 | 0,11 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aareal Bank AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 15.09.2020 | $ | 26.200 | 26.100 | 0,19 |
| 2,625 % fällig am 15.07.2021 | | 12.700 | 12.837 | 0,09 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,180 % fällig am 07.12.2020 | € | 300 | 338 | 0,00 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 19.900 | 22.858 | 0,16 |
| 3,150 % fällig am 22.01.2021 | $ | 8.200 | 8.141 | 0,06 |
| 3,407 % fällig am 22.01.2021 | | 9.500 | 9.376 | 0,07 |
| 3,855 % fällig am 04.02.2021 | | 9.400 | 9.325 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 43.300 | 43.911 | 0,32 |
| **Deutsche Hypothekenbank AG** | | | | |
| 1,043 % fällig am 22.03.2021 | £ | 800 | 1.018 | 0,01 |
| **Deutsche Pfandbriefbank AG** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.08.2019 | $ | 800 | 799 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 04.05.2020 | | 40.200 | 40.177 | 0,29 |
| 2,500 % fällig am 31.05.2022 | | 62.200 | 62.965 | 0,45 |
| 3,375 % fällig am 22.11.2021 | | 39.800 | 40.924 | 0,29 |
| **Deutsche Wohnen SE** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.07.2020 | € | 100 | 115 | 0,00 |
| **Hamburg Commercial Bank AG** | | | | |
| 0,250 % fällig am 19.11.2020 | | 651 | 748 | 0,01 |
| 0,250 % fällig am 25.04.2022 | | 200 | 231 | 0,00 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (c) | | 11.800 | 13.652 | 0,10 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (c) | | 8.600 | 9.965 | 0,07 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar und 6,750 % PIK)** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2027 (c) | $ | 600 | 604 | 0,00 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.04.2024 (d) | € | 36.300 | 42.229 | 0,30 |
| 0,000 % fällig am 04.07.2024 (d) | | 48.100 | 55.926 | 0,40 |
| 0,125 % fällig am 07.11.2023 | | 400 | 468 | 0,00 |
| 0,750 % fällig am 15.01.2029 | | 29.000 | 35.540 | 0,26 |
| 1,750 % fällig am 15.10.2019 | $ | 900 | 899 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 22.01.2021 | SEK | 4.000 | 455 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 19.03.2024 | AUD | 1.500 | 1.225 | 0,01 |
| **Landesbank Hessen-Thüringen Girozentrale** | | | | |
| 0,000 % fällig am 23.11.2020 (d) | € | 200 | 229 | 0,00 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,102 % fällig am 15.06.2021 | | 400 | 455 | 0,00 |
| 0,377 % fällig am 08.12.2021 | | 6.900 | 7.887 | 0,06 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,489 % fällig am 15.02.2021 | | 100 | 115 | 0,00 |
| 0,625 % fällig am 01.04.2022 | | 12.100 | 13.907 | 0,10 |
| 0,750 % fällig am 14.10.2021 | | 100 | 116 | 0,00 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 0,500 % fällig am 20.06.2022 | | 8.900 | 10.183 | 0,07 |
| 2,375 % fällig am 06.09.2022 | | 300 | 363 | 0,00 |
| | | | 474.081 | 3,40 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Land Berlin** | | | | |
| 4,250 % fällig am 25.04.2022 | | 119 | 154 | 0,00 |
| **Land Nordrhein-Westfalen** | | | | |
| 0,250 % fällig am 13.03.2026 | | 9.100 | 10.685 | 0,08 |
| 0,900 % fällig am 15.11.2028 | | 18.500 | 22.762 | 0,16 |
| | | | 33.601 | 0,24 |
| Summe Deutschland | | | 523.064 | 3,75 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 09.06.2023 | $ | 13.500 | $ 14.010 | 0,10 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AIA Group Ltd.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 06.04.2028 | | 5.940 | 6.321 | 0,05 |
| **CNOOC Finance Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 02.05.2022 | | 500 | 516 | 0,00 |
| **Eastern Creation Investment Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.09.2020 | | 5.900 | 5.905 | 0,04 |
| **Hong Kong Sukuk 2017 Ltd.** | | | | |
| 3,132 % fällig am 28.02.2027 | | 2.100 | 2.176 | 0,02 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.05.2022 | | 20.400 | 20.628 | 0,15 |
| 3,510 % fällig am 28.06.2021 | | 5.700 | 5.722 | 0,04 |
| **Poly Real Estate Finance Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 05.02.2023 | | 6.100 | 6.198 | 0,04 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 4,071 % fällig am 25.05.2023 | | 6.900 | 6.908 | 0,05 |
| | | | 54.374 | 0,39 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Hong Kong Government International Bond** | | | | |
| 1,160 % fällig am 18.05.2022 | HKD | 23.700 | 3.003 | 0,02 |
| 1,940 % fällig am 04.12.2023 | | 18.000 | 2.357 | 0,02 |
| 2,220 % fällig am 07.08.2024 | | 35.200 | 4.681 | 0,03 |
| 2,460 % fällig am 04.08.2021 | | 64.800 | 8.446 | 0,06 |
| | | | 18.487 | 0,13 |
| Summe Hongkong | | | 72.861 | 0,52 |
| **UNGARN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Hungary Government International Bond** | | | | |
| 3,000 % fällig am 27.10.2027 | HUF | 117.500 | 440 | 0,00 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ICICI Bank Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 18.03.2020 | $ | 3.768 | 3.784 | 0,03 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,835 % fällig am 13.12.2027 | | 6.300 | 6.418 | 0,04 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,700 % fällig am 27.02.2022 | | 6.600 | 6.700 | 0,05 |
| Summe Indien | | | 16.902 | 0,12 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Indonesia Asahan Aluminium Persero PT** | | | | |
| 5,230 % fällig am 15.11.2021 | | 3.900 | 4.113 | 0,03 |
| 5,710 % fällig am 15.11.2023 | | 3.400 | 3.734 | 0,03 |
| | | | 7.847 | 0,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 5,375 % fällig am 17.10.2023 | | 950 | 1.044 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 17.01.2038 | | 500 | 724 | 0,00 |
| | | | 1.768 | 0,01 |
| Summe Indonesien | | | 9.615 | 0,07 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,680 % fällig am 13.10.2029 | € | 1.500 | 1.704 | 0,01 |
| **Avoca CLO DAC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.01.2030 | | 4.000 | 4.559 | 0,03 |
| **Black Diamond CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | | 3.000 | 3.420 | 0,02 |
| 3,646 % fällig am 03.10.2029 | $ | 3.900 | 3.910 | 0,03 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,870 % fällig am 18.01.2030 | € | 15.300 | 17.425 | 0,13 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,780 % fällig am 16.04.2029 | € | 7.900 | $ 9.055 | 0,06 |
| 1,200 % fällig am 16.04.2029 | | 800 | 922 | 0,01 |
| **Castle Park CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.01.2028 | | 1.300 | 1.484 | 0,01 |
| **CVC Cordatus Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 0,970 % fällig am 22.04.2030 | | 18.580 | 21.249 | 0,15 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | | 10.650 | 12.131 | 0,09 |
| **Holland Park CLO Ltd.** | | | | |
| 0,621 % fällig am 14.05.2027 | | 14.603 | 16.642 | 0,12 |
| **SCF Rahoituspalvelut DAC** | | | | |
| 0,102 % fällig am 25.11.2025 | | 18 | 20 | 0,00 |
| **Sorrento Park CLO DAC** | | | | |
| 0,639 % fällig am 16.11.2027 | | 14.895 | 16.978 | 0,12 |
| 1,200 % fällig am 16.11.2027 | | 800 | 913 | 0,01 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 15.10.2030 | | 27.700 | 31.623 | 0,23 |
| | | | 142.035 | 1,02 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Abbott Ireland Financing DAC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 27.09.2020 (d) | | 100 | 114 | 0,00 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2025 | $ | 1.300 | 1.309 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.07.2020 | | 1.600 | 1.624 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 600 | 615 | 0,01 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.10.2023 | | 3.500 | 3.682 | 0,03 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (g)(i) | € | 5.100 | 6.142 | 0,04 |
| **Bank of Ireland Group PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 29.08.2023 | | 500 | 582 | 0,00 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | |
| 4,418 % fällig am 15.11.2035 | $ | 600 | 595 | 0,01 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 04.11.2020 | £ | 14.900 | 20.048 | 0,14 |
| **German Postal Pensions Securitisation PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 18.01.2022 | € | 300 | 383 | 0,00 |
| **Iberdrola Finance Ireland DAC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 11.09.2019 | $ | 300 | 301 | 0,00 |
| **Shire Acquisitions Investments Ireland DAC** | | | | |
| 1,900 % fällig am 23.09.2019 | | 4.000 | 3.994 | 0,03 |
| 2,400 % fällig am 23.09.2021 | | 5.600 | 5.595 | 0,04 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | | 900 | 912 | 0,01 |
| **SumitG Guaranteed Secured Obligation Issuer DAC** | | | | |
| 2,251 % fällig am 02.11.2020 | | 1.200 | 1.199 | 0,01 |
| | | | 47.095 | 0,34 |
| **AKTIEN** | | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (h)** | | 3.455.880 | 394.422 | 2,83 |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (h)** | | 5.807.640 | 589.417 | 4,23 |
| | | | 983.839 | 7,06 |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (h)** | | 310.397 | 3.132 | 0,02 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)** | | 345.274 | 4.019 | 0,03 |
| | | | 7.151 | 0,05 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Bluestep Mortgage Securities DAC** | | | | |
| 0,412 % fällig am 10.08.2066 | € | 172 | $ 196 | 0,00 |
| 1,453 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 65.154 | 7.058 | 0,05 |
| **Dilosk RMBS DAC** | | | | |
| 0,520 % fällig am 20.10.2057 | € | 100 | 114 | 0,00 |
| **Taurus UK DAC** | | | | |
| 1,654 % fällig am 17.11.2027 | £ | 298 | 378 | 0,01 |
| | | | 7.746 | 0,06 |
| Summe Irland | | | 1.187.866 | 8,53 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 17.01.2028 | $ | 8.300 | 8.778 | 0,06 |
| 4,125 % fällig am 17.01.2048 | | 7.600 | 8.339 | 0,06 |
| Summe Israel | | | 17.117 | 0,12 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banca Carige SpA** | | | | |
| 1,090 % fällig am 25.02.2021 | € | 45.100 | 51.569 | 0,37 |
| 1,389 % fällig am 25.10.2021 | | 11.100 | 12.784 | 0,09 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 2,000 % fällig am 29.01.2024 | | 26.600 | 31.297 | 0,23 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (g)(i) | | 8.600 | 10.355 | 0,07 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 (k) | $ | 25.710 | 29.390 | 0,21 |
| | | | 135.395 | 0,97 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Taurus IT SRL** | | | | |
| 1,188 % fällig am 18.02.2027 | € | 191 | 217 | 0,00 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,450 % fällig am 15.11.2024 | | 74.150 | 84.811 | 0,61 |
| 1,750 % fällig am 01.07.2024 | | 36.900 | 42.875 | 0,31 |
| 2,100 % fällig am 15.07.2026 | | 35.600 | 41.691 | 0,30 |
| 2,200 % fällig am 01.06.2027 | | 160 | 188 | 0,00 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (f) | | 2.944 | 3.615 | 0,03 |
| 2,500 % fällig am 15.11.2025 | | 37.900 | 45.613 | 0,33 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2029 | | 76.700 | 94.746 | 0,68 |
| 3,450 % fällig am 01.03.2048 | | 2.700 | 3.391 | 0,02 |
| **Italy Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 | £ | 5.484 | 8.220 | 0,06 |
| | | | 325.150 | 2,34 |
| Summe Italien | | | 460.762 | 3,31 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 2,091 % fällig am 14.09.2021 | $ | 14.700 | 14.561 | 0,11 |
| 2,170 % fällig am 05.08.2019 | | 600 | 600 | 0,01 |
| 2,362 % fällig am 28.05.2021 | | 1.200 | 1.199 | 0,01 |
| 2,567 % fällig am 02.11.2021 | | 70.700 | 70.962 | 0,51 |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | | 200 | 200 | 0,00 |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 2,701 % fällig am 16.03.2020 | | 500 | 500 | 0,00 |
| **Meiji Yasuda Life Insurance Co.** | | | | |
| 5,100 % fällig am 26.04.2048 | | 3.900 | 4.257 | 0,03 |
| **Mitsubishi Corp.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 14.07.2022 | | 400 | 403 | 0,00 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.03.2021 | | 10.900 | 11.009 | 0,08 |
| 3,455 % fällig am 02.03.2023 | | 24.400 | 25.103 | 0,18 |
| **Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,652 % fällig am 19.09.2022 | | 5.100 | 5.106 | 0,04 |
| **Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 16.10.2019 | | 1.100 | 1.100 | 0,01 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,451 % fällig am 11.09.2024 | | 12.700 | 12.827 | 0,09 |
| 3,549 % fällig am 05.03.2023 | | 20.400 | 21.120 | 0,15 |
| 3,922 % fällig am 11.09.2024 | | 10.800 | 11.315 | 0,08 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 21.07.2021 | $ | 400 | $ 397 | 0,00 |
| **ORIX Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 04.12.2024 | | 4.300 | 4.440 | 0,03 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,550 % fällig am 06.11.2023 | € | 35.900 | 42.028 | 0,30 |
| 2,440 % fällig am 18.06.2024 | $ | 26.400 | 26.666 | 0,19 |
| 2,450 % fällig am 16.01.2020 | | 500 | 500 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,452 % fällig am 19.07.2023 | | 29.700 | 29.840 | 0,22 |
| 3,748 % fällig am 19.07.2023 | | 29.200 | 30.681 | 0,22 |
| 4,133 % fällig am 09.03.2021 | | 800 | 817 | 0,01 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | |
| 0,237 % fällig am 21.11.2020 | € | 700 | 800 | 0,01 |
| 1,125 % fällig am 21.11.2022 | | 10.400 | 12.263 | 0,09 |
| 4,400 % fällig am 26.11.2023 | $ | 300 | 322 | 0,00 |
| **Toyota Industries Corp.** | | | | |
| 3,110 % fällig am 12.03.2022 | | 1.840 | 1.873 | 0,01 |
| **Toyota Motor Corp.** | | | | |
| 2,157 % fällig am 02.07.2022 (b) | | 4.300 | 4.301 | 0,03 |
| | | | 335.190 | 2,41 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Development Bank of Japan, Inc.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 01.09.2021 | | 26.300 | 26.059 | 0,19 |
| **Japan Bank for International Cooperation** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.11.2022 | | 5.500 | 5.562 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 01.06.2022 | | 1.300 | 1.319 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 20.07.2023 | | 9.200 | 9.622 | 0,07 |
| 3,375 % fällig am 31.10.2023 | | 9.000 | 9.477 | 0,07 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 2,125 % fällig am 13.04.2021 | | 16.100 | 16.091 | 0,12 |
| 2,625 % fällig am 20.04.2022 | | 28.200 | 28.571 | 0,21 |
| 3,000 % fällig am 12.03.2024 | | 13.500 | 13.994 | 0,10 |
| 3,375 % fällig am 27.09.2023 | | 20.200 | 21.090 | 0,15 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (f) | ¥ | 9.463.044 | 91.741 | 0,66 |
| 0,100 % fällig am 20.03.2029 | | 9.400.000 | 89.530 | 0,64 |
| 0,200 % fällig am 20.06.2036 | | 202.750 | 1.900 | 0,01 |
| 0,500 % fällig am 20.09.2046 | | 9.246.000 | 89.573 | 0,64 |
| 0,500 % fällig am 20.03.2049 | | 13.178.000 | 127.079 | 0,91 |
| 0,700 % fällig am 20.12.2048 | | 20.906.150 | 212.469 | 1,52 |
| 1,400 % fällig am 20.09.2034 | | 17.110.000 | 190.764 | 1,37 |
| 1,900 % fällig am 20.09.2042 | | 363.350 | 4.599 | 0,03 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.05.2021 | $ | 14.300 | 14.256 | 0,10 |
| 2,625 % fällig am 29.05.2024 | | 3.900 | 3.984 | 0,03 |
| | | | 957.680 | 6,87 |
| Summe Japan | | | 1.292.870 | 9,28 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 10.000 | 12.267 | 0,09 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kazakhstan Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 21.07.2025 | $ | 600 | 679 | 0,01 |
| **KUWAIT** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kuwait International Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.03.2022 | | 2.900 | 2.944 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2027 | | 57.200 | 60.984 | 0,44 |
| Summe Kuwait | | | 63.928 | 0,46 |
| **LITAUEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Lithuania Government International Bond** | | | | |
| 6,125 % fällig am 09.03.2021 | | 19.066 | 20.266 | 0,15 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | |
| 0,012 % fällig am 20.10.2023 | € | 15 | $ 17 | 0,00 |
| 0,012 % fällig am 20.05.2024 | | 2.933 | 3.344 | 0,02 |
| 0,012 % fällig am 20.10.2024 | | 83 | 95 | 0,00 |
| **Red & Black Auto Lease Germany S.A.** | | | | |
| 0,024 % fällig am 15.11.2027 | | 7.954 | 9.064 | 0,07 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | | |
| 0,074 % fällig am 17.03.2025 | | 6.616 | 7.551 | 0,06 |
| **VCL Multi-Compartment S.A.** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.09.2023 | | 253 | 288 | 0,00 |
| 0,009 % fällig am 21.08.2024 | | 1.051 | 1.200 | 0,01 |
| 0,009 % fällig am 21.01.2025 | | 278 | 318 | 0,00 |
| | | | 21.877 | 0,16 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Allergan Funding SCS** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.11.2023 | | 1.000 | 1.188 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 12.03.2020 | $ | 2.700 | 2.708 | 0,02 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.07.2024 | € | 8.500 | 10.102 | 0,07 |
| 2,000 % fällig am 02.11.2026 | | 7.200 | 8.628 | 0,06 |
| 3,000 % fällig am 16.10.2029 | £ | 100 | 124 | 0,00 |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 200 | 217 | 0,00 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.02.2024 | € | 500 | 598 | 0,00 |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | | 5.900 | 7.107 | 0,05 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | | 1.000 | 1.156 | 0,01 |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | | 300 | 350 | 0,00 |
| **Dream Global Funding SARL** | | | | |
| 1,750 % fällig am 28.06.2026 | | 12.800 | 14.742 | 0,11 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (d) | | 7.850 | 8.660 | 0,06 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | |
| 0,200 % fällig am 17.01.2024 | | 33.100 | 38.743 | 0,28 |
| 0,400 % fällig am 31.05.2026 | | 200 | 238 | 0,00 |
| 0,750 % fällig am 03.05.2027 | | 300 | 365 | 0,00 |
| 1,250 % fällig am 24.05.2033 | | 19.400 | 24.765 | 0,18 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | | 15.000 | 17.682 | 0,13 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | | 7.500 | 9.117 | 0,07 |
| **Medtronic Global Holdings S.C.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.12.2022 (b)(d) | | 10.900 | 12.432 | 0,09 |
| **NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank** | | | | |
| 0,250 % fällig am 10.03.2020 | | 1.100 | 1.258 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 16.02.2021 | $ | 19.800 | 20.023 | 0,14 |
| | | | 180.203 | 1,29 |
| Summe Luxemburg | | | 202.080 | 1,45 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Malaysia Government International Bond** | | | | |
| 3,654 % fällig am 31.10.2019 | MYR | 201.300 | 48.810 | 0,35 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 10.03.2021 | $ | 200 | 211 | 0,00 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | € | 100 | 116 | 0,00 |
| 8,500 % fällig am 31.05.2029 | MXN | 17.600 | 977 | 0,01 |
| 10,000 % fällig am 05.12.2024 | | 99.573 | 5.797 | 0,04 |
| | | | 6.890 | 0,05 |
| Summe Mexiko | | | 7.101 | 0,05 |
| **MAROKKO** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Morocco Government International Bond** | | | | |
| 4,500 % fällig am 05.10.2020 | € | 9.100 | 10.938 | 0,08 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Preferred Term Securities Ltd.** | | | | |
| 2,720 % fällig am 22.12.2036 | $ | 14.175 | $ 13.325 | 0,09 |
| 2,810 % fällig am 22.03.2038 | | 4.902 | 4.485 | 0,03 |
| 2,910 % fällig am 23.03.2035 | | 6.722 | 6.352 | 0,05 |
| Summe multinational | | | 24.162 | 0,17 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accunia European CLO BV** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 7.050 | 8.044 | 0,06 |
| **Barings Euro CLO BV** | | | | |
| 0,680 % fällig am 27.07.2030 | | 1.500 | 1.704 | 0,01 |
| 1,050 % fällig am 27.07.2030 | | 500 | 570 | 0,00 |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,930 % fällig am 30.04.2031 | | 5.500 | 6.287 | 0,04 |
| **Globaldrive Auto Receivables BV** | | | | |
| 0,109 % fällig am 20.08.2024 | | 97 | 111 | 0,00 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | | 4.300 | 4.885 | 0,03 |
| 0,530 % fällig am 12.07.2028 | | 4.324 | 4.924 | 0,04 |
| **Penta CLO BV** | | | | |
| 0,790 % fällig am 04.08.2028 | | 4.400 | 5.015 | 0,04 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,880 % fällig am 07.12.2029 (b) | | 9.400 | 10.705 | 0,08 |
| 1,060 % fällig am 07.12.2029 | | 2.400 | 2.735 | 0,02 |
| | | | 44.980 | 0,32 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | |
| 0,080 % fällig am 03.12.2021 | | 500 | 573 | 0,00 |
| 1,125 % fällig am 12.01.2032 | | 300 | 373 | 0,00 |
| **Aegon Bank NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2024 | | 4.800 | 5.510 | 0,04 |
| **BNG Bank NV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 01.10.2019 | CAD | 300 | 230 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 16.02.2021 | $ | 5.900 | 6.129 | 0,04 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,193 % fällig am 26.09.2023 | | 2.000 | 2.001 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 26.09.2023 | | 2.600 | 2.745 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 14.07.2025 | € | 100 | 142 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (g)(i) | | 3.800 | 4.511 | 0,03 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (g)(i) | | 6.000 | 7.579 | 0,06 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 (i) | | 15.450 | 18.469 | 0,13 |
| **Daimler International Finance BV** | | | | |
| 0,292 % fällig am 13.11.2019 | | 300 | 342 | 0,00 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 1,950 % fällig am 19.09.2021 | $ | 400 | 396 | 0,00 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 0,375 % fällig am 26.11.2021 | € | 23.300 | 26.855 | 0,19 |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | $ | 30.000 | 30.606 | 0,22 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.02.2029 | € | 300 | 364 | 0,00 |
| 3,320 % fällig am 02.10.2023 | $ | 10.400 | 10.395 | 0,08 |
| 4,100 % fällig am 02.10.2023 | | 12.100 | 12.791 | 0,09 |
| 4,700 % fällig am 22.03.2028 | | 800 | 834 | 0,01 |
| **JT International Financial Services BV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 28.09.2025 | € | 300 | 356 | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 28.09.2033 | £ | 7.400 | 9.721 | 0,07 |
| **Mylan NV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.12.2020 | $ | 300 | 303 | 0,00 |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | | 3.400 | 3.487 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 01.06.2023 | | 1.800 | 1.902 | 0,01 |
| **Shell International Finance BV** | | | | |
| 0,082 % fällig am 16.09.2019 | € | 100 | 114 | 0,00 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (g) | | 3.164 | 4.419 | 0,03 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | $ | 700 | 705 | 0,01 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,700 % fällig am 19.07.2019 | | 900 | 897 | 0,01 |
| 2,200 % fällig am 21.07.2021 | | 300 | 286 | 0,00 |
| 2,800 % fällig am 21.07.2023 | | 200 | 173 | 0,00 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2022 | € | 4.600 | 5.182 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 02.10.2023 | € | 3.700 | $ 4.300 | 0,03 |
| 1,239 % fällig am 16.11.2024 | | 42.900 | 49.884 | 0,36 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 09.04.2026 | | 11.200 | 13.619 | 0,10 |
| | | | 226.193 | 1,62 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,318 % fällig am 28.04.2051 | | 659 | 751 | 0,01 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 1,190 % fällig am 17.10.2040 | | 247 | 281 | 0,00 |
| | | | 1.032 | 0,01 |
| Summe Niederlande | | | 272.205 | 1,95 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ANZ New Zealand International Ltd.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 23.09.2019 | $ | 6.300 | 6.305 | 0,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Auckland Council** | | | | |
| 1,000 % fällig am 19.01.2027 | € | 6.000 | 7.269 | 0,05 |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | NZD | 1.083 | 795 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.04.2027 | | 2.440 | 2.011 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2023 | | 9.063 | 7.061 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 15.05.2021 | | 15.005 | 10.980 | 0,08 |
| | | | 28.116 | 0,20 |
| Summe Neuseeland | | | 34.421 | 0,25 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DNB Boligkreditt A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 28.03.2022 | $ | 26.700 | 27.038 | 0,20 |
| 3,250 % fällig am 28.06.2023 (k) | | 5.200 | 5.429 | 0,04 |
| **Sparebanken Soer Boligkreditt A/S** | | | | |
| 0,250 % fällig am 22.03.2021 | € | 2.600 | 2.995 | 0,02 |
| | | | 35.462 | 0,26 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kommunalbanken A/S** | | | | |
| 0,625 % fällig am 20.04.2026 | | 600 | 716 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 15.07.2024 | AUD | 3.300 | 2.734 | 0,02 |
| **Norway Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.03.2025 | NOK | 86.700 | 10.433 | 0,07 |
| 1,750 % fällig am 17.02.2027 | | 1.100 | 133 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 26.04.2028 | | 7.300 | 898 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 25.05.2021 | | 97.500 | 11.972 | 0,08 |
| | | | 26.886 | 0,19 |
| Summe Norwegen | | | 62.348 | 0,45 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | PEN | 15.900 | 4.948 | 0,03 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 54.900 | 18.225 | 0,13 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 81.648 | 27.322 | 0,20 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 97.800 | 33.411 | 0,24 |
| Summe Peru | | | 83.906 | 0,60 |
| **POLEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **PKO Bank Hipoteczny S.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 23.11.2021 | € | 300 | 345 | 0,00 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Poland Government International Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.07.2027 | PLN | 3.865 | 1.051 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 25.07.2025 | | 30.700 | 8.759 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 25.10.2023 | | 300 | 87 | 0,00 |
| | | | 9.897 | 0,07 |
| Summe Polen | | | 10.242 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **PORTUGAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^ | € | 6.900 | $ 1.925 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | | 1.900 | 530 | 0,00 |
| Summe Portugal | | | 2.455 | 0,02 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Qatari Diar Finance Co.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 21.07.2020 | $ | 2.800 | 2.872 | 0,02 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2019 | | 6.700 | 6.762 | 0,05 |
| | | | 9.634 | 0,07 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.03.2024 | | 44.200 | 45.730 | 0,33 |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | | 6.950 | 7.298 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 14.03.2029 | | 47.600 | 51.380 | 0,37 |
| 4,500 % fällig am 23.04.2028 | | 23.800 | 26.666 | 0,19 |
| 4,817 % fällig am 14.03.2049 | | 21.200 | 24.350 | 0,18 |
| | | | 155.424 | 1,12 |
| Summe Katar | | | 165.058 | 1,19 |
| **RUMÄNIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 28.10.2024 | € | 550 | 704 | 0,01 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 7,250 % fällig am 10.05.2034 | RUB | 1.940.200 | 30.372 | 0,22 |
| 7,650 % fällig am 10.04.2030 | | 2.600.100 | 42.277 | 0,30 |
| 7,950 % fällig am 07.10.2026 | | 2.165.600 | 35.635 | 0,26 |
| Summe Russland | | | 108.284 | 0,78 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 26.10.2021 | $ | 88.900 | 88.859 | 0,64 |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 17.200 | 17.426 | 0,12 |
| 3,250 % fällig am 26.10.2026 | | 6.900 | 7.050 | 0,05 |
| 3,625 % fällig am 04.03.2028 | | 18.700 | 19.242 | 0,14 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 40.400 | 43.062 | 0,31 |
| 4,375 % fällig am 16.04.2029 | | 12.300 | 13.316 | 0,10 |
| 4,500 % fällig am 17.04.2030 | | 33.500 | 36.604 | 0,26 |
| Summe Saudi-Arabien | | | 225.559 | 1,62 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 4.200 | 4.195 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 18.09.2027 | | 4.400 | 4.384 | 0,03 |
| 3,626 % fällig am 02.05.2021 | | 2.100 | 2.111 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 27.04.2026 | | 2.000 | 2.048 | 0,01 |
| **DBS Bank Ltd.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 27.11.2021 | | 8.900 | 9.122 | 0,07 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | | |
| 2,975 % fällig am 17.05.2021 | | 13.700 | 13.710 | 0,10 |
| **PSA Treasury Pte. Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 12.04.2026 | | 200 | 198 | 0,00 |
| **Temasek Financial Ltd.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.03.2022 | € | 750 | 872 | 0,01 |
| **United Overseas Bank Ltd.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 09.03.2021 | | 100 | 115 | 0,00 |
| 2,125 % fällig am 02.03.2020 | $ | 600 | 599 | 0,00 |
| | | | 37.354 | 0,27 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Singapore Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.02.2024 | SGD | 930 | $ 695 | 0,01 |
| 2,625 % fällig am 01.05.2028 | | 410 | 318 | 0,00 |
| | | | 1.013 | 0,01 |
| Summe Singapur | | | 38.367 | 0,28 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 1,000 % fällig am 06.03.2028 | € | 200 | 247 | 0,00 |
| 1,188 % fällig am 14.03.2029 | | 16.500 | 20.622 | 0,15 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 35.452 | 39.910 | 0,29 |
| Summe Slowenien | | | 60.779 | 0,44 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | |
| 7,750 % fällig am 28.02.2023 | ZAR | 4.275 | 308 | 0,00 |
| 8,750 % fällig am 28.02.2048 | | 2.125 | 137 | 0,00 |
| Summe Südafrika | | | 445 | 0,00 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **KEB Hana Bank** | | | | |
| 4,375 % fällig am 30.09.2024 (i) | $ | 500 | 532 | 0,00 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2029 (i) | | 2.600 | 2.800 | 0,02 |
| | | | 3.332 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.07.2023 | | 4.400 | 4.602 | 0,03 |
| **Korea Government International Bond** | | | | |
| 2,125 % fällig am 10.06.2027 | KRW | 16.365.000 | 14.742 | 0,11 |
| 2,625 % fällig am 10.06.2028 | | 32.730.000 | 30.789 | 0,22 |
| 2,375 % fällig am 10.12.2028 | | 32.730.000 | 30.299 | 0,22 |
| | | | 80.432 | 0,58 |
| Summe Südkorea | | | 83.764 | 0,60 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Asset-Backed European Securitisation Transaction** | | | | |
| 0,004 % fällig am 23.08.2030 | € | 307 | 351 | 0,00 |
| **Driver Espana FT** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.12.2028 | | 329 | 377 | 0,00 |
| 0,011 % fällig am 21.04.2028 | | 5.916 | 6.763 | 0,05 |
| | | | 7.491 | 0,05 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (g)(i) | | 2.200 | 2.597 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (g)(i) | | 12.200 | 14.622 | 0,11 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (g)(i) | | 6.000 | 7.034 | 0,05 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 4,379 % fällig am 12.04.2028 | $ | 2.600 | 2.769 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 19.03.2025 (g)(i) | € | 34.000 | 36.692 | 0,26 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (g)(i) | | 7.000 | 8.400 | 0,06 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | | 10.300 | 12.252 | 0,09 |
| **Merlin Properties Socimi S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 26.05.2025 | | 6.200 | 7.402 | 0,05 |
| **Telefonica Emisiones S.A.U.** | | | | |
| 2,318 % fällig am 17.10.2028 | | 100 | 129 | 0,00 |
| | | | 91.897 | 0,66 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **AyT Hipotecario Mixto FTA** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 20.01.2043 | € | 1.337 | $ | 1.499 | 0,01 |
| **Fondo de Titulizacion de Activos Santander Hipotecario** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.07.2042 | | 2.282 | | 2.598 | 0,02 |
| 0,000 % fällig am 18.01.2049 | | 946 | | 1.067 | 0,01 |
| **Fondo de Titulizacion de Activos UCI** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.09.2041 | | 1.542 | | 1.731 | 0,01 |
| **IM Pastor Fondo de Titulizacion Hipotecaria** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 22.09.2041 | | 6 | | 7 | 0,00 |
| **TDA Mixto Fondo de Titulizacion de Activos** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.06.2032 | | 99 | | 112 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 22.06.2045 | | 11 | | 13 | 0,00 |
| | | | | 7.027 | 0,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Autonomous Community of Andalusia** | | | | | |
| 4,850 % fällig am 17.03.2020 | | 100 | | 118 | 0,00 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | | |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035 | | 3.900 | | 5.347 | 0,04 |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | | 28.500 | | 35.119 | 0,25 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 19.200 | | 22.489 | 0,16 |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | | |
| 0,747 % fällig am 30.04.2022 | | 15.800 | | 18.495 | 0,13 |
| 1,571 % fällig am 30.04.2029 | | 800 | | 1.000 | 0,01 |
| **Instituto de Credito Oficial** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 31.03.2020 | CAD | 2.000 | | 1.545 | 0,01 |
| **Spain Government International Bond** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 30.07.2024 | € | 52.650 | | 61.225 | 0,44 |
| 0,600 % fällig am 31.10.2029 | | 114.850 | | 132.804 | 0,95 |
| 1,400 % fällig am 30.07.2028 | | 97.750 | | 122.113 | 0,88 |
| 1,450 % fällig am 31.10.2027 | | 700 | | 877 | 0,01 |
| 1,450 % fällig am 30.04.2029 | | 12.500 | | 15.688 | 0,11 |
| 1,500 % fällig am 30.04.2027 | | 600 | | 753 | 0,01 |
| 1,600 % fällig am 30.04.2025 | | 35 | | 44 | 0,00 |
| 1,950 % fällig am 30.04.2026 | | 400 | | 514 | 0,00 |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | | 2.050 | | 2.651 | 0,02 |
| 2,700 % fällig am 31.10.2048 | | 10.300 | | 15.436 | 0,11 |
| 5,250 % fällig am 06.04.2029 | £ | 800 | | 1.268 | 0,01 |
| | | | | 437.486 | 3,14 |
| Summe Spanien | | | | 543.901 | 3,90 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Asian Development Bank** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 24.03.2020 | AUD | 1.000 | | 696 | 0,01 |
| **EUROFIMA** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 30.06.2020 | | 1.440 | | 1.052 | 0,01 |
| **Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.09.2023 | | 5.400 | | 3.573 | 0,03 |
| 0,500 % fällig am 21.12.2023 | | 4.800 | | 3.193 | 0,02 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.04.2025 | € | 200 | | 232 | 0,00 |
| 0,050 % fällig am 24.05.2024 | | 24.400 | | 28.449 | 0,20 |
| 0,500 % fällig am 10.08.2023 | AUD | 10.200 | | 6.855 | 0,05 |
| 0,625 % fällig am 22.01.2029 | € | 5.900 | | 7.143 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 07.12.2028 | £ | 53 | | 96 | 0,00 |
| **Europäischer Stabilitätsmechanismus** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.01.2022 (d) | € | 600 | | 693 | 0,00 |
| Summe übernational | | | | 51.982 | 0,37 |
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Danske Hypotek AB** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 21.12.2022 | SEK | 100.000 | | 11.138 | 0,08 |
| **Landshypotek Bank AB** | | | | | |
| 0,700 % fällig am 09.05.2022 | | 465.000 | | 51.041 | 0,37 |
| **Lansforsakringar Hypotek AB** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 20.09.2023 | | 167.600 | | 18.927 | 0,14 |
| 1,500 % fällig am 18.03.2021 | € | 10.600 | | 12.474 | 0,09 |
| 2,250 % fällig am 21.09.2022 | SEK | 50.800 | | 5.873 | 0,04 |
| **Nordea Hypotek AB** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 08.04.2022 | | 363.300 | | 40.299 | 0,29 |
| 1,250 % fällig am 20.09.2023 | | 100.000 | | 11.297 | 0,08 |
| **Skandinaviska Enskilda Banken AB** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.12.2023 | SEK | 120.000 | $ | 13.427 | 0,10 |
| 1,500 % fällig am 15.12.2021 | | 538.000 | | 60.248 | 0,43 |
| **Stadshypotek AB** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.12.2021 | | 227.000 | | 25.421 | 0,18 |
| 1,500 % fällig am 01.06.2023 | | 120.000 | | 13.659 | 0,10 |
| 1,875 % fällig am 02.10.2019 | $ | 2.200 | | 2.198 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 05.04.2022 | | 30.350 | | 30.659 | 0,22 |
| 4,500 % fällig am 21.09.2022 | SEK | 361.000 | | 44.562 | 0,32 |
| **Sveriges Sakerstallda Obligationer AB** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.06.2022 | | 360.000 | | 40.277 | 0,29 |
| 2,000 % fällig am 17.06.2026 | | 53.000 | | 6.291 | 0,04 |
| **Swedbank Hypotek AB** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.09.2021 | | 594.200 | | 65.603 | 0,47 |
| Summe Schweden | | | | 453.394 | 3,25 |
| **SCHWEIZ** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.09.2021 | € | 4.600 | | 5.370 | 0,04 |
| 1,375 % fällig am 29.11.2019 | | 100 | | 115 | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2021 | | 4.000 | | 4.705 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (i) | $ | 19.306 | | 21.297 | 0,15 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | | 12.050 | | 12.433 | 0,09 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 2,200 % fällig am 08.06.2020 | | 19.400 | | 19.393 | 0,14 |
| 2,450 % fällig am 01.12.2020 | | 10.600 | | 10.617 | 0,08 |
| 3,000 % fällig am 01.12.2020 | | 14.400 | | 14.451 | 0,10 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (i) | | 5.050 | | 5.366 | 0,04 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (i) | | 1.925 | | 2.160 | 0,01 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | | |
| 0,378 % fällig am 20.09.2022 | € | 800 | | 917 | 0,01 |
| 2,950 % fällig am 24.09.2020 | $ | 8.000 | | 8.055 | 0,06 |
| Summe Schweiz | | | | 104.879 | 0,75 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.02.2020 | | 10.600 | | 10.578 | 0,08 |
| 3,000 % fällig am 30.03.2022 | | 1.600 | | 1.617 | 0,01 |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 16.700 | | 16.804 | 0,12 |
| | | | | 28.999 | 0,21 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | | 21.300 | | 21.487 | 0,15 |
| 3,125 % fällig am 11.10.2027 | | 20.300 | | 21.097 | 0,15 |
| | | | | 42.584 | 0,30 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | | 71.583 | 0,51 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | | |
| 1,310 % fällig am 20.09.2028 | £ | 24.600 | | 31.364 | 0,22 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Annington Funding PLC** | | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.07.2024 | € | 100 | | 117 | 0,00 |
| **AstraZeneca PLC** | | | | | |
| 3,190 % fällig am 17.08.2023 | $ | 900 | | 898 | 0,01 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (i) | | 57.479 | | 62.801 | 0,45 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 08.06.2020 | | 300 | | 300 | 0,00 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | £ | 800 | | 1.049 | 0,01 |
| 3,200 % fällig am 10.08.2021 | $ | 2.600 | | 2.620 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | £ | 600 | | 780 | 0,01 |
| 3,650 % fällig am 16.03.2025 | $ | 4.900 | | 4.935 | 0,04 |
| 3,684 % fällig am 10.01.2023 | | 200 | | 203 | 0,00 |
| 3,905 % fällig am 16.05.2024 | | 8.000 | | 7.888 | 0,06 |
| 3,948 % fällig am 15.02.2023 | | 19.700 | | 19.609 | 0,14 |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | | 21.400 | | 22.153 | 0,16 |
| 4,655 % fällig am 10.08.2021 | | 8.300 | | 8.485 | 0,06 |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | | 600 | | 640 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (g)(i) | € | 7.000 | $ | 8.071 | 0,06 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (g)(i) | £ | 1.500 | | 1.928 | 0,01 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (g)(i) | | 3.800 | | 5.060 | 0,04 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (g)(i) | $ | 2.200 | | 2.257 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (g)(i)(k) | € | 10.850 | | 13.391 | 0,10 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(i) | $ | 10.300 | | 10.810 | 0,08 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | | 1.700 | | 1.704 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 07.06.2022 | | 1.500 | | 1.522 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 07.07.2020 | € | 100 | | 119 | 0,00 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.10.2021 | $ | 200 | | 207 | 0,00 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 10.03.2023 | € | 9.800 | | 11.580 | 0,08 |
| 9,625 % fällig am 15.12.2030 | $ | 708 | | 1.069 | 0,01 |
| **Diageo Finance PLC** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 22.10.2021 | € | 3.600 | | 4.139 | 0,03 |
| **FCE Bank PLC** | | | | | |
| 0,662 % fällig am 17.09.2019 | | 200 | | 228 | 0,00 |
| 1,528 % fällig am 09.11.2020 | | 200 | | 232 | 0,00 |
| 1,875 % fällig am 24.06.2021 | | 500 | | 583 | 0,00 |
| **Frontier Finance PLC** | | | | | |
| 8,000 % fällig am 23.03.2022 | £ | 14.700 | | 19.548 | 0,14 |
| **Grainger PLC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2028 | | 1.400 | | 1.842 | 0,01 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 0,578 % fällig am 04.12.2021 | € | 500 | | 574 | 0,00 |
| 2,650 % fällig am 05.01.2022 | $ | 100 | | 100 | 0,00 |
| 2,950 % fällig am 25.05.2021 | | 7.500 | | 7.568 | 0,05 |
| 3,000 % fällig am 22.07.2028 | £ | 11.900 | | 15.811 | 0,11 |
| 3,086 % fällig am 11.09.2021 | $ | 27.400 | | 27.431 | 0,20 |
| 3,120 % fällig am 18.05.2021 | | 12.600 | | 12.612 | 0,09 |
| 3,520 % fällig am 18.05.2024 | | 6.600 | | 6.621 | 0,05 |
| 3,950 % fällig am 18.05.2024 | | 800 | | 837 | 0,01 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 21.700 | | 22.685 | 0,16 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029 | | 9.000 | | 9.851 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 23.03.2028 (g)(i) | | 7.100 | | 7.449 | 0,05 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.08.2023 | € | 200 | | 233 | 0,00 |
| 2,125 % fällig am 12.02.2027 | | 300 | | 357 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 21.07.2022 | $ | 700 | | 721 | 0,01 |
| **INEOS Grangemouth PLC** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 30.07.2019 | € | 600 | | 686 | 0,00 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 25.03.2024 | | 800 | | 927 | 0,01 |
| 0,375 % fällig am 18.01.2021 | | 800 | | 922 | 0,01 |
| 2,700 % fällig am 17.08.2020 | $ | 400 | | 402 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 29.09.2020 | € | 700 | | 841 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | £ | 18.400 | | 29.190 | 0,21 |
| 5,125 % fällig am 07.03.2025 | | 300 | | 461 | 0,00 |
| 5,800 % fällig am 13.01.2020 | $ | 3.070 | | 3.125 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 08.02.2029 | £ | 150 | | 265 | 0,00 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 27.06.2020 (g)(i) | € | 1.500 | | 1.774 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 27.09.2025 (g)(i) | $ | 14.800 | | 15.571 | 0,11 |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (g)(i) | £ | 300 | | 417 | 0,00 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (g)(i) | | 4.680 | | 6.771 | 0,05 |
| **Mondi Finance PLC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 28.09.2020 | € | 600 | | 712 | 0,01 |
| **National Express Group PLC** | | | | | |
| 0,089 % fällig am 15.05.2020 | | 500 | | 570 | 0,00 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 08.03.2026 | | 900 | | 1.048 | 0,01 |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | $ | 10.200 | | 10.654 | 0,08 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | | |
| 0,080 % fällig am 02.03.2020 | € | 700 | | 798 | 0,01 |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | | 3.700 | | 4.237 | 0,03 |
| 0,625 % fällig am 02.03.2022 | | 4.000 | | 4.579 | 0,03 |
| **Network Rail Infrastructure Finance PLC** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.11.2035 | £ | 62 | | 116 | 0,00 |
| **RAC Bond Co. PLC** | | | | | |
| 4,565 % fällig am 06.05.2046 | | 5.190 | | 6.581 | 0,05 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.06.2022 | $ | 11.200 | | 11.194 | 0,08 |
| 2,903 % fällig am 24.06.2022 | | 600 | | 598 | 0,00 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 08.03.2023 | € | 6.400 | | 7.531 | 0,05 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 900 | | 1.065 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,498 % fällig am 15.05.2023 | $ | 8.900 | $ 9.004 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | | 5.000 | 5.134 | 0,04 |
| 3,988 % fällig am 15.05.2023 | | 10.600 | 10.575 | 0,08 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 5.000 | 5.174 | 0,04 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 200 | 208 | 0,00 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 15.200 | 16.504 | 0,12 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (g)(i) | | 6.900 | 7.090 | 0,05 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (g)(i) | | 5.000 | 5.401 | 0,04 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 05.08.2021 | | 1.200 | 1.202 | 0,01 |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | | 7.000 | 7.072 | 0,05 |
| 4,796 % fällig am 15.11.2024 | | 19.500 | 20.731 | 0,15 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (g)(i) | £ | 3.900 | 5.283 | 0,04 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 3,178 % fällig am 15.11.2021 | $ | 10.700 | 10.735 | 0,08 |
| 3,750 % fällig am 15.11.2021 | | 11.200 | 11.553 | 0,08 |
| 4,250 % fällig am 12.04.2021 | € | 5.600 | 6.905 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 02.03.2026 | £ | 300 | 490 | 0,00 |
| **Society of Lloyd's** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | | 650 | 916 | 0,01 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.10.2023 | € | 9.200 | 10.852 | 0,08 |
| **Tesco PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | £ | 50 | 71 | 0,00 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 1.152 | 1.874 | 0,01 |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | | 295 | 485 | 0,00 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 484 | 806 | 0,01 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 5.809 | 9.780 | 0,07 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | | 8.300 | 10.903 | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | | 5.900 | 7.762 | 0,06 |
| **Virgin Money PLC** | | | | |
| 1,417 % fällig am 22.03.2024 | | 12.000 | 15.375 | 0,11 |
| 2,250 % fällig am 21.04.2020 | | 3.850 | 4.938 | 0,04 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 30.05.2028 | $ | 100 | 108 | 0,00 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | |
| 1,250 % fällig am 11.06.2021 | € | 200 | 235 | 0,00 |
| | | | 627.819 | 4,51 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Aggregator of Loans Backed by Assets PLC** | | | | |
| 1,972 % fällig am 24.04.2049 | £ | 8.260 | 10.546 | 0,08 |
| **Alba PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2038 | € | 157 | 169 | 0,00 |
| 0,944 % fällig am 21.11.2037 | £ | 1.037 | 1.247 | 0,01 |
| 0,956 % fällig am 15.12.2038 | | 7.173 | 8.625 | 0,06 |
| **Business Mortgage Finance PLC** | | | | |
| 2,806 % fällig am 15.02.2041 | | 101 | 127 | 0,00 |
| **Dukinfield PLC** | | | | |
| 1,806 % fällig am 15.08.2045 | | 13.379 | 17.076 | 0,12 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 0,936 % fällig am 15.06.2044 | | 28 | 34 | 0,00 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 10.12.2044 | € | 270 | 305 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 15.12.2044 | | 200 | 217 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | | 544 | 585 | 0,00 |
| 0,946 % fällig am 10.06.2044 | £ | 2.332 | 2.949 | 0,02 |
| 0,946 % fällig am 10.12.2044 | | 545 | 685 | 0,00 |
| 1,489 % fällig am 13.09.2045 | | 1.601 | 1.977 | 0,01 |
| 1,739 % fällig am 13.06.2045 | | 80 | 102 | 0,00 |
| **Feldspar PLC** | | | | |
| 1,486 % fällig am 15.09.2045 | | 1.916 | 2.441 | 0,02 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,473 % fällig am 12.09.2065 | | 15.114 | 19.232 | 0,14 |
| 1,743 % fällig am 12.09.2068 | | 30.668 | 39.148 | 0,28 |
| 1,910 % fällig am 16.06.2069 | | 400 | 510 | 0,00 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | |
| 0,139 % fällig am 15.02.2058 | € | 1.000 | 1.141 | 0,01 |
| 0,139 % fällig am 24.07.2058 | | 93 | 106 | 0,00 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.06.2038 | | 879 | 989 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 18.03.2039 | | 701 | 788 | 0,01 |
| 1,021 % fällig am 18.03.2039 | £ | 4.670 | 5.412 | 0,04 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 2,195 % fällig am 25.05.2053 | | 11.818 | 15.069 | 0,11 |
| **Holmes Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,101 % fällig am 15.10.2054 | £ | 3.714 | $ 4.726 | 0,03 |
| **Lanark Master Issuer PLC** | | | | |
| 0,136 % fällig am 22.12.2054 | € | 582 | 663 | 0,00 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2061 | | 741 | 799 | 0,01 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 1,436 % fällig am 15.12.2049 | £ | 12.200 | 15.155 | 0,11 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.12.2050 | € | 3.261 | 3.417 | 0,02 |
| 0,282 % fällig am 15.12.2050 | | 1.093 | 1.205 | 0,01 |
| 0,932 % fällig am 15.12.2050 | | 3.230 | 3.530 | 0,03 |
| 0,984 % fällig am 01.12.2050 | £ | 804 | 973 | 0,01 |
| 0,993 % fällig am 01.12.2050 | | 584 | 689 | 0,00 |
| 1,182 % fällig am 15.12.2050 | € | 5.637 | 6.123 | 0,04 |
| 1,786 % fällig am 15.12.2050 | £ | 4.508 | 5.529 | 0,04 |
| 2,036 % fällig am 15.12.2050 | | 3.610 | 4.419 | 0,03 |
| **Oncilla Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 2,193 % fällig am 12.12.2043 | | 10.508 | 13.476 | 0,10 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 0,002 % fällig am 15.06.2041 | € | 497 | 545 | 0,00 |
| 1,061 % fällig am 15.01.2039 | £ | 13.405 | 16.189 | 0,12 |
| 1,760 % fällig am 15.05.2045 (b) | | 31.200 | 39.736 | 0,29 |
| 2,738 % fällig am 15.11.2038 | $ | 39 | 37 | 0,00 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,582 % fällig am 20.03.2050 | £ | 3.953 | 5.024 | 0,04 |
| 1,732 % fällig am 20.12.2046 | | 13.286 | 16.930 | 0,12 |
| 1,936 % fällig am 15.06.2046 | | 30 | 38 | 0,00 |
| **Resloc UK PLC** | | | | |
| 0,946 % fällig am 15.12.2043 | | 87 | 104 | 0,00 |
| 1,006 % fällig am 15.12.2043 | | 4.109 | 4.814 | 0,03 |
| 2,570 % fällig am 15.12.2043 | $ | 217 | 206 | 0,00 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | £ | 44.610 | 56.719 | 0,41 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,493 % fällig am 12.06.2046 | | 34.124 | 43.025 | 0,31 |
| 1,763 % fällig am 12.06.2046 | | 18.460 | 23.478 | 0,17 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.06.2044 | € | 1.351 | 1.436 | 0,01 |
| 0,943 % fällig am 12.06.2044 | £ | 573 | 688 | 0,00 |
| **Rochester Financing PLC** | | | | |
| 2,081 % fällig am 18.06.2045 | | 3.403 | 4.354 | 0,03 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.01.2070 | € | 465 | 530 | 0,00 |
| 0,139 % fällig am 21.01.2070 | | 500 | 570 | 0,00 |
| 3,148 % fällig am 21.01.2070 | $ | 200 | 200 | 0,00 |
| **Southern Pacific Financing PLC** | | | | |
| 1,046 % fällig am 10.03.2044 | £ | 587 | 720 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 36.600 | 46.758 | 0,34 |
| 2,004 % fällig am 20.02.2054 | | 3.835 | 4.892 | 0,03 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,781 % fällig am 12.12.2052 | | 11.400 | 14.494 | 0,10 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 0,986 % fällig am 10.06.2059 | | 4.086 | 4.975 | 0,04 |
| 1,024 % fällig am 10.10.2040 | | 97 | 117 | 0,00 |
| 1,136 % fällig am 10.06.2059 | | 994 | 1.190 | 0,01 |
| 1,336 % fällig am 10.06.2059 | | 777 | 930 | 0,01 |
| 1,536 % fällig am 10.06.2059 | | 830 | 991 | 0,01 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.12.2049 (d) | | 1 | 5.117 | 0,04 |
| 1,584 % fällig am 21.12.2049 | | 67.854 | 85.792 | 0,62 |
| 2,284 % fällig am 21.12.2049 | | 7.280 | 9.407 | 0,07 |
| 2,784 % fällig am 21.12.2049 | | 3.640 | 4.633 | 0,03 |
| 3,284 % fällig am 21.12.2049 | | 2.080 | 2.656 | 0,02 |
| 3,784 % fällig am 21.12.2049 | | 2.080 | 2.605 | 0,02 |
| | | | 590.084 | 4,23 |
| **AKTIEN** | | | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % | | 34.271 | 6.603 | 0,05 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,750 % fällig am 22.07.2023 | £ | 105 | 134 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 22.07.2047 | | 335 | 429 | 0,01 |
| 1,750 % fällig am 07.09.2022 | £ | 25 | $ 33 | 0,00 |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | | 150 | 261 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 07.06.2032 | | 200 | 352 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2040 | | 300 | 583 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2046 | | 200 | 413 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 07.03.2020 | | 24 | 31 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 07.12.2038 | | 5.700 | 11.487 | 0,08 |
| | | | 13.723 | 0,10 |
| Summe Großbritannien | | | 1.269.593 | 9,11 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.09.2036 | $ | 5.755 | 5.662 | 0,04 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.10.2036 | | 6 | 3 | 0,00 |
| 2,534 % fällig am 25.12.2036 | | 8.206 | 5.311 | 0,04 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 2.492 | 1.205 | 0,01 |
| 3,199 % fällig am 25.01.2035 | | 994 | 996 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.12.2034 | | 1.425 | 1.413 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.08.2035 | | 7.600 | 7.560 | 0,05 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,904 % fällig am 25.09.2035 | | 1.968 | 1.979 | 0,01 |
| 3,454 % fällig am 25.11.2034 | | 771 | 776 | 0,01 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | |
| 3,104 % fällig am 25.10.2031 | | 58 | 57 | 0,00 |
| **AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,344 % fällig am 25.06.2029 | | 52 | 51 | 0,00 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 3.883 | 3.386 | 0,02 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 3,104 % fällig am 25.06.2034 | | 394 | 393 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,814 % fällig am 25.12.2035 | | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,814 % fällig am 25.02.2036 | | 6.108 | 6.623 | 0,05 |
| 3,044 % fällig am 25.12.2034 | | 36 | 35 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.10.2032 | | 15 | 15 | 0,00 |
| 3,404 % fällig am 25.10.2037 | | 2.895 | 2.916 | 0,02 |
| 3,404 % fällig am 25.11.2042 | | 32 | 32 | 0,00 |
| 3,409 % fällig am 25.06.2035 | | 1.882 | 1.887 | 0,01 |
| 3,454 % fällig am 25.08.2037 | | 3.450 | 3.049 | 0,02 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,864 % fällig am 25.06.2035 | | 838 | 841 | 0,01 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,780 % fällig am 25.10.2037 | | 8.063 | 8.176 | 0,06 |
| 3,880 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 3.153 | 3.174 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.07.2045 | | 92 | 72 | 0,00 |
| 5,764 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 181 | 127 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 25.05.2036 | | 1.999 | 1.492 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.06.2037 | | 8.000 | 7.789 | 0,06 |
| 3,124 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 252 | 253 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.06.2037 | | 2.388 | 2.265 | 0,02 |
| 2,544 % fällig am 25.07.2037 | | 1.284 | 1.170 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.08.2037 | | 8.791 | 8.680 | 0,06 |
| 2,604 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 3.852 | 3.043 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.08.2037 | | 15.000 | 13.586 | 0,10 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 1.104 | 924 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.06.2047 | | 21.000 | 20.386 | 0,15 |
| 2,724 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 9.950 | 6.875 | 0,05 |
| 2,744 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 186 | 123 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.11.2034 | | 263 | 265 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.** | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.09.2046 | | 3.500 | 3.354 | 0,02 |
| 2,864 % fällig am 25.05.2036 | | 199 | 199 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.08.2035 | | 5.064 | 5.040 | 0,04 |
| 3,124 % fällig am 25.07.2034 | | 395 | 397 | 0,00 |
| 3,244 % fällig am 25.10.2047 | | 6.341 | 6.348 | 0,05 |
| 5,270 % fällig am 25.02.2035 | | 252 | 257 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Crecera Americas LLC** | | | | |
| 7,078 % fällig am 30.11.2021 | CLP | 4.120.528 | $ 5.897 | 0,04 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 3,024 % fällig am 25.01.2032 | $ | 32 | 31 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.11.2036 | | 22 | 14 | 0,00 |
| **CSAB Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 6,172 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 288 | 140 | 0,00 |
| **Delta Funding Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,034 % fällig am 15.08.2030 | | 22 | 22 | 0,00 |
| **EMC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,144 % fällig am 25.05.2040 | | 20 | 20 | 0,00 |
| **Encore Credit Receivables Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.01.2036 | | 9.700 | 9.532 | 0,07 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,550 % fällig am 25.11.2036 | | 2.610 | 1.705 | 0,01 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.10.2035 | | 1.380 | 1.379 | 0,01 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 2,539 % fällig am 25.10.2036 | | 3.467 | 3.267 | 0,02 |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 | | 3.190 | 2.056 | 0,02 |
| 3,469 % fällig am 25.06.2035 | | 7.800 | 7.798 | 0,06 |
| **GLS Auto Receivables Trust** | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.08.2022 | | 6.809 | 6.841 | 0,05 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.04.2047 | | 502 | 337 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.06.2036 | | 4.070 | 2.183 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.03.2037 | | 416 | 258 | 0,00 |
| **GSAA Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.05.2047 | | 225 | 183 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 2,534 % fällig am 25.12.2046 | | 3.830 | 2.510 | 0,02 |
| 2,634 % fällig am 25.12.2046 | | 9.626 | 6.161 | 0,04 |
| 2,854 % fällig am 25.11.2035 | | 6.580 | 6.437 | 0,05 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,684 % fällig am 25.08.2036 | | 954 | 953 | 0,01 |
| 3,104 % fällig am 25.12.2033 | | 33 | 32 | 0,00 |
| 3,324 % fällig am 25.02.2033 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.11.2036 | | 10.869 | 8.942 | 0,06 |
| 2,724 % fällig am 25.04.2037 | | 5.178 | 4.726 | 0,03 |
| **Home Equity Mortgage Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 519 | 256 | 0,00 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.02.2036 | | 3.700 | 3.680 | 0,03 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.08.2036 | | 4.245 | 3.158 | 0,02 |
| 2,534 % fällig am 25.08.2036 | | 3.287 | 3.243 | 0,02 |
| 2,674 % fällig am 25.08.2036 | | 8.000 | 7.372 | 0,05 |
| **Lehman ABS Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,494 % fällig am 25.06.2037 | | 139 | 102 | 0,00 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 84 | 81 | 0,00 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.05.2036 | | 5.358 | 3.582 | 0,03 |
| 2,964 % fällig am 25.10.2034 | | 538 | 529 | 0,00 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,504 % fällig am 25.08.2036 | | 5.748 | 2.781 | 0,02 |
| **MASTR Specialized Loan Trust** | | | | |
| 3,504 % fällig am 25.06.2043 | | 41 | 41 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,484 % fällig am 25.09.2037 | | 22 | 13 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.05.2036 | | 759 | 752 | 0,01 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.05.2037 | | 376 | 337 | 0,00 |
| 2,529 % fällig am 25.07.2036 | | 793 | 695 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2036 | | 5.564 | 3.137 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.04.2036 | | 7.586 | 7.281 | 0,05 |
| 4,330 % fällig am 25.02.2047 | | 2.309 | 2.143 | 0,02 |
| 4,654 % fällig am 25.03.2033 | | 95 | 92 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.04.2037 | | 4.971 | 3.364 | 0,02 |
| **Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | |
| 2,454 % fällig am 25.11.2036 | | 3 | 1 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.02.2037 | | 251 | 118 | 0,00 |
| 2,764 % fällig am 25.04.2037 | | 397 | 189 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2037 ^ | $ | 150 | $ 103 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 252 | 201 | 0,00 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,139 % fällig am 25.06.2035 | | 8.389 | 8.408 | 0,06 |
| 3,700 % fällig am 20.06.2031 | | 424 | 429 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,944 % fällig am 25.05.2036 | | 3.000 | 2.819 | 0,02 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 | | 1.049 | 790 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.03.2037 | | 4.388 | 3.643 | 0,03 |
| 2,594 % fällig am 25.01.2036 | | 473 | 475 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.04.2037 | | 5.707 | 4.660 | 0,03 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | | 6.974 | 4.835 | 0,04 |
| 3,084 % fällig am 25.11.2034 | | 71 | 69 | 0,00 |
| 3,139 % fällig am 25.08.2035 | | 892 | 892 | 0,01 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.05.2037 | | 2.401 | 2.016 | 0,02 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.08.2035 | | 1.122 | 1.128 | 0,01 |
| **RAAC Trust** | | | | |
| 2,744 % fällig am 25.08.2036 | | 167 | 169 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.06.2047 | | 144 | 145 | 0,00 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,104 % fällig am 25.08.2032 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,404 % fällig am 25.12.2033 | | 185 | 183 | 0,00 |
| 5,340 % fällig am 25.01.2037 | | 15.713 | 8.385 | 0,06 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.12.2036 | | 1.600 | 1.571 | 0,01 |
| 2,744 % fällig am 25.12.2035 | | 6.091 | 5.546 | 0,04 |
| 2,964 % fällig am 25.06.2032 | | 52 | 50 | 0,00 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,714 % fällig am 25.09.2047 | | 5.046 | 4.926 | 0,04 |
| 2,724 % fällig am 25.09.2047 | | 4.729 | 4.712 | 0,03 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 2,534 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 251 | 195 | 0,00 |
| 2,550 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 94 | 32 | 0,00 |
| 2,954 % fällig am 25.10.2035 | | 2.208 | 2.126 | 0,02 |
| **SG Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.07.2036 | | 3.474 | 1.090 | 0,01 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2023 | € | 68 | 77 | 0,00 |
| 0,232 % fällig am 15.12.2033 | | 1.624 | 1.793 | 0,01 |
| **SoFi Consumer Loan Program LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.05.2026 | $ | 38 | 38 | 0,00 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.03.2037 | | 1.023 | 990 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.07.2037 | | 3.064 | 2.594 | 0,02 |
| 2,584 % fällig am 25.07.2037 | | 257 | 237 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.06.2037 | | 9.470 | 7.096 | 0,05 |
| 2,614 % fällig am 25.06.2037 | | 18.266 | 13.074 | 0,09 |
| 2,654 % fällig am 25.11.2036 | | 10.700 | 10.091 | 0,07 |
| 2,674 % fällig am 25.12.2036 | | 12.500 | 11.880 | 0,09 |
| 3,304 % fällig am 25.10.2037 | | 7.953 | 6.660 | 0,05 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.12.2036 | | 715 | 706 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,539 % fällig am 25.07.2036 | | 1.215 | 1.193 | 0,01 |
| 3,940 % fällig am 25.04.2035 | | 21 | 21 | 0,00 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | | |
| 0,504 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 254 | 111 | 0,00 |
| 3,344 % fällig am 25.11.2033 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Upstart Securitization Trust** | | | | |
| 3,887 % fällig am 20.08.2025 | | 1.193 | 1.195 | 0,01 |
| 4,997 % fällig am 20.08.2025 | | 2.100 | 2.131 | 0,02 |
| **Utah State Board of Regents** | | | | |
| 3,154 % fällig am 25.01.2057 | | 126 | 126 | 0,00 |
| 3,159 % fällig am 25.09.2056 | | 117 | 117 | 0,00 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | | 1.356 | 1.363 | 0,01 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | | 3.868 | 3.227 | 0,02 |
| **Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.10.2036 | | 63 | 33 | 0,00 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.01.2037 | | 8.000 | 7.282 | 0,05 |
| | | | 384.203 | 2,76 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 14.05.2020 | $ | 900 | $ 900 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 14.11.2023 | | 5.700 | 5.938 | 0,04 |
| 4,250 % fällig am 14.11.2028 | | 100 | 107 | 0,00 |
| **Air Lease Corp.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.02.2024 | | 9.800 | 10.345 | 0,07 |
| **Allergan Finance LLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.10.2022 | | 4.900 | 4.963 | 0,04 |
| **Allergan Sales LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2021 | | 3.900 | 4.080 | 0,03 |
| **Allergan, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.09.2020 | | 1.000 | 1.009 | 0,01 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 2.300 | 2.306 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 600 | 607 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 15.09.2020 | | 200 | 211 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 300 | 398 | 0,00 |
| **Amazon.com, Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 22.08.2027 | | 100 | 105 | 0,00 |
| **American Express Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.05.2022 | | 10.600 | 10.733 | 0,08 |
| 3,140 % fällig am 20.05.2022 | | 13.900 | 13.960 | 0,10 |
| 3,375 % fällig am 17.05.2021 | | 8.800 | 8.969 | 0,06 |
| **American Honda Finance Corp.** | | | | |
| 2,915 % fällig am 05.11.2021 | | 5.100 | 5.113 | 0,04 |
| **American International Group, Inc.** | | | | |
| 6,400 % fällig am 15.12.2020 | | 150 | 158 | 0,00 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 04.04.2025 | € | 200 | 237 | 0,00 |
| 1,950 % fällig am 22.05.2026 | | 5.400 | 6.574 | 0,05 |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | $ | 1.000 | 1.002 | 0,01 |
| 2,950 % fällig am 15.01.2025 | | 14.800 | 14.925 | 0,11 |
| 3,450 % fällig am 15.09.2021 | | 600 | 613 | 0,00 |
| 3,800 % fällig am 15.08.2029 | | 7.400 | 7.644 | 0,06 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 01.10.2020 | | 3.200 | 3.244 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 15.11.2021 | | 1.200 | 1.239 | 0,01 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2019 | | 2.100 | 2.110 | 0,02 |
| **Anheuser-Busch Cos. LLC** | | | | |
| 4,900 % fällig am 01.02.2046 | | 150 | 167 | 0,00 |
| **Anheuser-Busch InBev Finance, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.02.2024 | | 2.900 | 3.056 | 0,02 |
| **Anthem, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 21.11.2020 | | 100 | 100 | 0,00 |
| 4,101 % fällig am 01.03.2028 | | 900 | 964 | 0,01 |
| **Apple, Inc.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 12.09.2027 | | 100 | 102 | 0,00 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 0,528 % fällig am 05.09.2023 | € | 100 | 115 | 0,00 |
| 1,800 % fällig am 05.09.2026 | | 13.200 | 16.296 | 0,12 |
| 3,247 % fällig am 15.01.2020 | $ | 49.500 | 49.626 | 0,36 |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | | 25.800 | 25.936 | 0,19 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 33.700 | 34.005 | 0,24 |
| 3,616 % fällig am 12.06.2024 | | 14.600 | 14.794 | 0,11 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.08.2025 | | 23.600 | 24.595 | 0,18 |
| 7,125 % fällig am 15.10.2020 | | 21.284 | 22.518 | 0,16 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,471 % fällig am 04.05.2023 | € | 1.400 | 1.606 | 0,01 |
| 2,328 % fällig am 01.10.2021 | $ | 11.100 | 11.089 | 0,08 |
| 2,369 % fällig am 21.07.2021 | | 4.000 | 3.996 | 0,03 |
| 3,004 % fällig am 20.12.2023 | | 3.023 | 3.080 | 0,02 |
| 3,864 % fällig am 23.07.2024 | | 100 | 105 | 0,00 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 2,297 % fällig am 14.08.2020 | | 700 | 699 | 0,01 |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | | 8.300 | 8.322 | 0,06 |
| 3,222 % fällig am 15.08.2024 | | 18.200 | 18.332 | 0,13 |
| 3,398 % fällig am 15.08.2022 | | 100 | 100 | 0,00 |
| 3,557 % fällig am 15.08.2027 | | 100 | 100 | 0,00 |
| **Baxalta, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 23.06.2020 | | 358 | 359 | 0,00 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,979 % fällig am 25.06.2021 | | 5.500 | 5.465 | 0,04 |
| 3,420 % fällig am 15.12.2023 | | 10.200 | 10.023 | 0,07 |
| 3,875 % fällig am 15.12.2023 | | 5.600 | 5.819 | 0,04 |
| 4,250 % fällig am 15.12.2025 | | 5.200 | 5.506 | 0,04 |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028 | | 4.300 | 4.538 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVE-RMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Berkshire Hathaway, Inc.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 17.01.2021 | € | 200 | $ 229 | 0,00 |
| **Blackstone Holdings Finance Co. LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2044 | $ | 900 | 1.023 | 0,01 |
| **BMW U.S. Capital LLC** | | | | |
| 2,898 % fällig am 14.08.2020 | | 1.200 | 1.203 | 0,01 |
| 3,035 % fällig am 13.08.2021 | | 11.100 | 11.136 | 0,08 |
| **BP Capital Markets America, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 10.05.2023 | | 700 | 708 | 0,01 |
| 3,224 % fällig am 14.04.2024 | | 50 | 52 | 0,00 |
| 3,790 % fällig am 06.02.2024 | | 4.600 | 4.874 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 01.10.2020 | | 100 | 103 | 0,00 |
| **Broadcom Corp.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.01.2021 | | 100 | 99 | 0,00 |
| 2,650 % fällig am 15.01.2023 | | 800 | 789 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2022 | | 900 | 903 | 0,01 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.04.2026 | | 100 | 102 | 0,00 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.03.2021 | | 6.500 | 6.586 | 0,05 |
| **CenterPoint Energy Resources Corp.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.04.2023 | | 4.100 | 4.227 | 0,03 |
| **CenterPoint Energy, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.11.2021 | | 1.900 | 1.953 | 0,01 |
| **CH Robinson Worldwide, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.04.2028 | | 2.200 | 2.359 | 0,02 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 700 | 706 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2028 | | 10.900 | 10.987 | 0,08 |
| 4,229 % fällig am 01.02.2024 | | 7.700 | 7.737 | 0,06 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 22.900 | 24.071 | 0,17 |
| 4,500 % fällig am 01.02.2024 | | 3.500 | 3.733 | 0,03 |
| 6,384 % fällig am 23.10.2035 | | 24.500 | 28.814 | 0,21 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.03.2021 | | 3.100 | 3.167 | 0,02 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 2,844 % fällig am 20.05.2022 | | 11.750 | 11.843 | 0,09 |
| 3,123 % fällig am 20.05.2022 | | 22.100 | 22.136 | 0,16 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.07.2026 | € | 200 | 240 | 0,00 |
| 2,700 % fällig am 30.03.2021 | $ | 12.400 | 12.468 | 0,09 |
| **CNH Industrial Capital LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 06.11.2020 | | 2.200 | 2.246 | 0,02 |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 3,227 % fällig am 15.04.2024 | | 12.400 | 12.460 | 0,09 |
| **Commonwealth Edison Co.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 01.09.2021 | | 200 | 204 | 0,00 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.05.2024 | | 5.200 | 5.520 | 0,04 |
| 4,600 % fällig am 01.11.2025 | | 50 | 55 | 0,00 |
| **Consolidated Edison Co. of New York, Inc.** | | | | |
| 2,749 % fällig am 25.06.2021 | | 4.900 | 4.914 | 0,04 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.01.2028 | | 3.700 | 3.897 | 0,03 |
| **CRH America Finance, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 04.04.2028 | | 600 | 614 | 0,00 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.02.2029 | | 2.500 | 2.704 | 0,02 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 3,083 % fällig am 09.03.2020 | | 100 | 100 | 0,00 |
| 3,350 % fällig am 09.03.2021 | | 1.100 | 1.116 | 0,01 |
| 3,700 % fällig am 09.03.2023 | | 5.800 | 6.002 | 0,04 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.02.2020 | | 1.100 | 1.108 | 0,01 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 06.07.2021 | | 500 | 495 | 0,00 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 7.700 | 7.937 | 0,06 |
| **Discover Bank** | | | | |
| 4,200 % fällig am 08.08.2023 | | 2.700 | 2.867 | 0,02 |
| 4,650 % fällig am 13.09.2028 | | 4.900 | 5.363 | 0,04 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 3,950 % fällig am 20.03.2028 | | 75 | 77 | 0,00 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 100 | 101 | 0,00 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | $ | 12.100 | $ 12.158 | 0,09 |
| **DTE Energy Co.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 01.12.2019 | | 600 | 600 | 0,00 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 09.03.2022 | | 100 | 104 | 0,00 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 2.300 | 2.288 | 0,02 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | | 100 | 102 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.04.2024 | | 1.300 | 1.384 | 0,01 |
| **Entergy Arkansas, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.06.2024 | | 1.100 | 1.165 | 0,01 |
| **EPR Properties** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.06.2027 | | 1.200 | 1.253 | 0,01 |
| **EQT Corp.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2020 | | 1.100 | 1.097 | 0,01 |
| 3,089 % fällig am 01.10.2020 | | 1.100 | 1.099 | 0,01 |
| **Equifax, Inc.** | | | | |
| 3,388 % fällig am 15.08.2021 | | 2.900 | 2.893 | 0,02 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | |
| 3,800 % fällig am 01.11.2025 | | 2.500 | 2.649 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 16.08.2021 | | 600 | 626 | 0,00 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.07.2024 | | 5.300 | 5.353 | 0,04 |
| 3,200 % fällig am 01.07.2026 | | 300 | 307 | 0,00 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,343 % fällig am 02.11.2020 | | 500 | 497 | 0,00 |
| 2,681 % fällig am 09.01.2020 | | 21.400 | 21.390 | 0,15 |
| 3,273 % fällig am 24.09.2020 | | 31.300 | 31.277 | 0,22 |
| 3,336 % fällig am 18.03.2021 | | 5.000 | 5.027 | 0,04 |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 | | 15.400 | 15.678 | 0,11 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2021 | | 200 | 208 | 0,00 |
| **GATX Corp.** | | | | |
| 3,285 % fällig am 05.11.2021 | | 6.400 | 6.375 | 0,05 |
| **General Mills, Inc.** | | | | |
| 3,141 % fällig am 16.04.2021 | | 3.100 | 3.102 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 300 | 319 | 0,00 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 0,207 % fällig am 26.03.2022 | € | 2.100 | 2.361 | 0,02 |
| 0,372 % fällig am 10.05.2021 | | 100 | 114 | 0,00 |
| 2,350 % fällig am 04.10.2019 | $ | 900 | 900 | 0,01 |
| 3,442 % fällig am 09.04.2021 | | 200 | 200 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 10.07.2019 | | 100 | 100 | 0,00 |
| 3,550 % fällig am 08.07.2022 | | 2.600 | 2.648 | 0,02 |
| **Georgia-Pacific LLC** | | | | |
| 5,400 % fällig am 01.11.2020 | | 100 | 104 | 0,00 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2025 | | 1.500 | 1.611 | 0,01 |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | | 5.000 | 5.408 | 0,04 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,132 % fällig am 16.12.2020 | € | 500 | 570 | 0,00 |
| 0,307 % fällig am 09.09.2022 | | 100 | 114 | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 15.09.2020 | $ | 100 | 100 | 0,00 |
| 2,875 % fällig am 03.06.2026 | € | 100 | 130 | 0,00 |
| 3,688 % fällig am 15.11.2021 | $ | 7.600 | 7.664 | 0,06 |
| 3,752 % fällig am 23.04.2020 | | 200 | 201 | 0,00 |
| 3,850 % fällig am 08.07.2024 | | 100 | 105 | 0,00 |
| 4,223 % fällig am 01.05.2029 | | 20.100 | 21.575 | 0,16 |
| 5,000 % fällig am 21.08.2019 | AUD | 3.700 | 2.609 | 0,02 |
| **Goodman U.S. Finance Three LLC** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | $ | 6.600 | 6.681 | 0,05 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.01.2021 | | 600 | 601 | 0,00 |
| 3,460 % fällig am 02.03.2021 | | 9.400 | 9.389 | 0,07 |
| **Harris Corp.** | | | | |
| 3,063 % fällig am 30.04.2020 | | 400 | 400 | 0,00 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.09.2026 | | 2.170 | 2.344 | 0,02 |
| 5,875 % fällig am 01.02.2029 | | 500 | 549 | 0,00 |
| **Hewlett Packard Enterprise Co.** | | | | |
| 3,318 % fällig am 05.10.2021 | | 10.600 | 10.602 | 0,08 |
| 3,500 % fällig am 05.10.2021 | | 1.700 | 1.741 | 0,01 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 3,202 % fällig am 18.09.2020 | | 11.300 | 11.309 | 0,08 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 4.300 | 4.641 | 0,03 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.09.2022 (b) | $ | 17.000 | $ 17.020 | 0,12 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 3,797 % fällig am 23.07.2024 | | 12.091 | 12.688 | 0,09 |
| 3,900 % fällig am 15.07.2025 | | 2.500 | 2.672 | 0,02 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 2,926 % fällig am 26.04.2021 | | 26.900 | 26.937 | 0,19 |
| 3,086 % fällig am 26.04.2021 | | 21.400 | 21.524 | 0,15 |
| **KeyBank N.A.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.12.2019 | | 800 | 800 | 0,01 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.12.2024 | | 1.200 | 1.236 | 0,01 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 6,950 % fällig am 15.01.2038 | | 600 | 770 | 0,01 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | | |
| 2,118 % fällig am 11.09.2020 | | 200 | 199 | 0,00 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 30.06.2023 | € | 2.800 | 3.376 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 01.06.2026 | $ | 100 | 97 | 0,00 |
| 3,115 % fällig am 10.02.2021 | | 3.800 | 3.794 | 0,03 |
| 3,375 % fällig am 15.06.2021 | | 500 | 509 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 15.02.2025 | | 1.700 | 1.754 | 0,01 |
| **Kroger Co.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 30.09.2019 | | 100 | 100 | 0,00 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.05.2010 ^ | | 8.800 | 152 | 0,00 |
| 5,625 % fällig am 24.01.2013 ^ | | 12.700 | 223 | 0,00 |
| 6,200 % fällig am 26.09.2014 ^ | | 9.800 | 177 | 0,00 |
| 7,875 % fällig am 08.05.2018 ^ | £ | 14.000 | 445 | 0,00 |
| **MassMutual Global Funding** | | | | |
| 2,250 % fällig am 01.07.2022 (b) | $ | 5.000 | 5.007 | 0,04 |
| **McDonald's Corp.** | | | | |
| 3,012 % fällig am 28.10.2021 | | 5.300 | 5.305 | 0,04 |
| **McKesson Corp.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 17.08.2021 | € | 100 | 115 | 0,00 |
| **Memorial Sloan-Kettering Cancer Center** | | | | |
| 4,200 % fällig am 01.07.2055 | $ | 50 | 57 | 0,00 |
| **Metropolitan Life Global Funding** | | | | |
| 1,250 % fällig am 17.09.2021 | € | 500 | 588 | 0,00 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | $ | 2.000 | 2.095 | 0,02 |
| **Microsoft Corp.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 08.08.2026 | | 75 | 75 | 0,00 |
| **Mississippi Power Co.** | | | | |
| 2,961 % fällig am 27.03.2020 | | 5.800 | 5.802 | 0,04 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,087 % fällig am 21.05.2021 | € | 800 | 913 | 0,01 |
| 3,095 % fällig am 10.02.2021 | $ | 4.250 | 4.256 | 0,03 |
| 3,249 % fällig am 10.06.2022 | | 31.000 | 31.046 | 0,22 |
| 3,875 % fällig am 29.04.2024 | | 75 | 80 | 0,00 |
| **Mylan, Inc.** | | | | |
| 4,550 % fällig am 15.04.2028 | | 1.200 | 1.178 | 0,01 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 30.06.2021 | | 14.700 | 14.741 | 0,11 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 26.10.2020 | | 1.600 | 1.636 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 25.03.2021 | | 300 | 313 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 700 | 726 | 0,01 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | | 23.900 | 23.909 | 0,17 |
| 3,241 % fällig am 25.02.2022 | | 21.200 | 21.327 | 0,15 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 1,550 % fällig am 13.09.2019 | | 600 | 599 | 0,00 |
| 2,800 % fällig am 13.01.2022 | | 4.800 | 4.814 | 0,03 |
| 2,930 % fällig am 15.03.2021 | | 3.400 | 3.392 | 0,02 |
| 2,970 % fällig am 13.09.2019 | | 400 | 400 | 0,00 |
| 3,150 % fällig am 15.03.2021 | | 100 | 101 | 0,00 |
| 3,875 % fällig am 21.09.2023 | | 1.200 | 1.245 | 0,01 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.03.2029 | | 900 | 963 | 0,01 |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | | 4.400 | 4.780 | 0,03 |
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 08.07.2021 | | 1.100 | 1.115 | 0,01 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 3,450 % fällig am 01.07.2024 | | 5.000 | 5.156 | 0,04 |
| **Philip Morris International, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 22.08.2022 | | 1.100 | 1.105 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Physicians Realty LP** | | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.03.2027 | $ | 600 | $ | 620 | 0,00 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.01.2021 | | 100 | | 101 | 0,00 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | | |
| 3,650 % fällig am 01.06.2022 | | 1.600 | | 1.639 | 0,01 |
| **Private Export Funding Corp.** | | | | | |
| 2,100 % fällig am 19.12.2019 | | 1.500 | | 1.499 | 0,01 |
| **Progress Energy, Inc.** | | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.01.2021 | | 300 | | 308 | 0,00 |
| **QVC, Inc.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2023 | | 500 | | 508 | 0,00 |
| **Rockwell Collins, Inc.** | | | | | |
| 3,100 % fällig am 15.11.2021 | | 100 | | 101 | 0,00 |
| **Ryder System, Inc.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.06.2022 | | 6.400 | | 6.476 | 0,05 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 6.700 | | 7.456 | 0,05 |
| **Sempra Energy** | | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 7.000 | | 6.973 | 0,05 |
| **Southern Co.** | | | | | |
| 2,350 % fällig am 01.07.2021 | | 500 | | 500 | 0,00 |
| **Southern Co. Gas Capital Corp.** | | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.10.2023 | | 1.747 | | 1.744 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 15.06.2026 | | 2.400 | | 2.422 | 0,02 |
| **Spectra Energy Partners LP** | | | | | |
| 3,179 % fällig am 05.06.2020 | | 300 | | 301 | 0,00 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | | |
| 3,210 % fällig am 15.06.2021 | | 1.300 | | 1.292 | 0,01 |
| 3,950 % fällig am 15.06.2023 | | 3.600 | | 3.718 | 0,03 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 1.100 | | 1.184 | 0,01 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 3.500 | | 3.636 | 0,03 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | | |
| 3,360 % fällig am 20.03.2023 | | 1.294 | | 1.297 | 0,01 |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | | 5.600 | | 5.824 | 0,04 |
| **Stryker Corp.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 30.11.2020 | € | 200 | | 228 | 0,00 |
| **Sunoco Logistics Partners Operations LP** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.02.2020 | $ | 100 | | 102 | 0,00 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.09.2021 | | 800 | | 821 | 0,01 |
| **Toyota Motor Credit Corp.** | | | | | |
| 2,925 % fällig am 17.05.2022 | | 160 | | 160 | 0,00 |
| **United Technologies Corp.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.05.2020 | € | 800 | | 912 | 0,01 |
| 3,650 % fällig am 16.08.2023 | $ | 13.740 | | 14.400 | 0,10 |
| 4,125 % fällig am 16.11.2028 | | 5.330 | | 5.861 | 0,04 |
| **UnitedHealth Group, Inc.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.02.2023 | | 1.200 | | 1.217 | 0,01 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | | |
| 3,376 % fällig am 15.02.2025 | | 14 | | 15 | 0,00 |
| 4,016 % fällig am 03.12.2029 | | 90 | | 98 | 0,00 |
| 4,329 % fällig am 21.09.2028 | | 31.984 | | 35.475 | 0,25 |
| 4,522 % fällig am 15.09.2048 | | 1.835 | | 2.059 | 0,01 |
| 4,812 % fällig am 15.03.2039 | | 120 | | 138 | 0,00 |
| 4,862 % fällig am 21.08.2046 | | 1.586 | | 1.849 | 0,01 |
| **Virginia Electric & Power Co.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.03.2023 | | 500 | | 507 | 0,00 |
| **VMware, Inc.** | | | | | |
| 2,300 % fällig am 21.08.2020 | | 6.400 | | 6.384 | 0,05 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | | |
| 2,400 % fällig am 22.05.2020 | | 500 | | 499 | 0,00 |
| 2,450 % fällig am 20.11.2019 | | 200 | | 200 | 0,00 |
| 3,305 % fällig am 13.11.2020 | | 7.600 | | 7.633 | 0,06 |
| 3,475 % fällig am 12.11.2021 | | 7.300 | | 7.361 | 0,05 |
| 3,875 % fällig am 13.11.2020 | | 4.700 | | 4.801 | 0,03 |
| 4,000 % fällig am 12.11.2021 | | 6.300 | | 6.505 | 0,05 |
| **Warner Media LLC** | | | | | |
| 1,950 % fällig am 15.09.2023 | € | 350 | | 425 | 0,00 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 04.03.2021 | $ | 9.400 | | 9.424 | 0,07 |
| 2,600 % fällig am 22.07.2020 | | 5.400 | | 5.419 | 0,04 |
| 3,465 % fällig am 11.02.2022 | | 100 | | 101 | 0,00 |
| 3,691 % fällig am 24.01.2023 | | 13.000 | | 13.163 | 0,09 |
| 3,813 % fällig am 31.10.2023 | | 33.500 | | 34.152 | 0,25 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | | | |
| 2,897 % fällig am 27.05.2022 | $ | 9.000 | $ | 9.087 | 0,07 |
| 3,092 % fällig am 23.07.2021 | | 250 | | 250 | 0,00 |
| 3,141 % fällig am 27.05.2022 | | 23.000 | | 23.056 | 0,17 |
| **WRKCo, Inc.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2028 | | 5.100 | | 5.300 | 0,04 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | | |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | | 5.700 | | 5.791 | 0,04 |
| 3,550 % fällig am 01.04.2025 | | 22.400 | | 23.105 | 0,17 |
| | | | | 1.322.062 | 9,49 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **CenturyLink, Inc.** | | | | | |
| 5,152 % fällig am 31.01.2025 | | 11.032 | | 10.787 | 0,08 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | | |
| 6,270 % fällig am 15.02.2050 | | 100 | | 134 | 0,00 |
| **American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010** | | | | | |
| 7,734 % fällig am 15.02.2033 | | 100 | | 144 | 0,00 |
| 7,834 % fällig am 15.02.2041 | | 1.700 | | 2.698 | 0,02 |
| **California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | | |
| 7,700 % fällig am 01.11.2030 | | 100 | | 107 | 0,00 |
| **California State General Obligation Bonds, Series 2017** | | | | | |
| 3,211 % fällig am 01.04.2047 | | 10.195 | | 10.230 | 0,07 |
| **Chicago Transit Authority, Illinois Revenue Bonds, Series 2008** | | | | | |
| 6,899 % fällig am 01.12.2040 | | 3.600 | | 4.881 | 0,04 |
| **Iowa Tobacco Settlement Authority Revenue Bonds, Series 2005** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.06.2023 | | 805 | | 816 | 0,01 |
| **Los Angeles County, California Public Works Financing Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | | |
| 7,618 % fällig am 01.08.2040 | | 2.800 | | 4.379 | 0,03 |
| **Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | | |
| 6,655 % fällig am 01.04.2057 | | 298 | | 390 | 0,00 |
| **Utah State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009** | | | | | |
| 4,554 % fällig am 01.07.2024 | | 15 | | 16 | 0,00 |
| | | | | 23.795 | 0,17 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 3,554 % fällig am 25.03.2035 | | 876 | | 827 | 0,01 |
| 4,446 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 152 | | 146 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.05.2046 ^ | | 513 | | 483 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 1.378 | | 1.317 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.10.2046 | | 109 | | 77 | 0,00 |
| 3,424 % fällig am 25.11.2046 | | 9.227 | | 4.670 | 0,03 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | | |
| 4,185 % fällig am 25.09.2035 | | 5.099 | | 3.408 | 0,03 |
| 4,213 % fällig am 25.10.2034 | | 33 | | 33 | 0,00 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | | |
| 2,543 % fällig am 20.02.2047 | | 1.529 | | 1.490 | 0,01 |
| 4,492 % fällig am 20.10.2046 ^ | | 190 | | 154 | 0,00 |
| 4,648 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 283 | | 276 | 0,00 |
| 4,753 % fällig am 20.02.2036 | | 778 | | 778 | 0,01 |
| 4,870 % fällig am 20.11.2035 ^ | | 211 | | 203 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 | | 21 | | 22 | 0,00 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | | |
| 4,659 % fällig am 25.09.2035 | | 62 | | 59 | 0,00 |
| 4,787 % fällig am 25.09.2033 | | 14 | | 14 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 45 | | 43 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 413 | | 391 | 0,00 |
| 3,148 % fällig am 26.01.2047 | | 863 | | 811 | 0,01 |
| 4,211 % fällig am 26.02.2036 | | 77 | | 78 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2037 | | 1.271 | | 1.074 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 26.08.2037 | | 723 | | 739 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 28.02.2037 | | 1.263 | | 1.207 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 3,443 % fällig am 25.05.2034 | | 144 | | 136 | 0,00 |
| 4,345 % fällig am 25.08.2033 | | 15 | | 15 | 0,00 |
| 4,392 % fällig am 25.05.2047 ^ | $ | 240 | $ | 228 | 0,00 |
| 4,454 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 131 | | 116 | 0,00 |
| 4,607 % fällig am 25.10.2033 | | 97 | | 99 | 0,00 |
| 4,673 % fällig am 25.02.2034 | | 22 | | 23 | 0,00 |
| 4,806 % fällig am 25.08.2033 | | 152 | | 158 | 0,00 |
| 4,870 % fällig am 25.05.2034 | | 181 | | 180 | 0,00 |
| 4,910 % fällig am 25.02.2036 | | 175 | | 171 | 0,00 |
| 4,944 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 1.238 | | 1.210 | 0,01 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.02.2034 | | 114 | | 116 | 0,00 |
| 3,987 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 3.830 | | 3.215 | 0,02 |
| 3,999 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 735 | | 669 | 0,01 |
| 4,016 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.767 | | 1.204 | 0,01 |
| 4,089 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 16 | | 14 | 0,00 |
| 4,159 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 1.113 | | 978 | 0,01 |
| 4,187 % fällig am 25.03.2036 | | 414 | | 299 | 0,00 |
| 4,294 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 2.790 | | 2.354 | 0,02 |
| 4,331 % fällig am 25.01.2036 | | 3.446 | | 3.457 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 25.05.2035 | | 93 | | 95 | 0,00 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.12.2046 | | 790 | | 769 | 0,01 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | | |
| 3,801 % fällig am 26.12.2046 ^ | | 2.939 | | 2.548 | 0,02 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | | |
| 3,799 % fällig am 25.07.2037 | | 83 | | 75 | 0,00 |
| 4,044 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 113 | | 112 | 0,00 |
| 4,239 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 1.240 | | 1.244 | 0,01 |
| 4,791 % fällig am 25.02.2037 | | 458 | | 469 | 0,00 |
| **Citicorp Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 145 | | 144 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,570 % fällig am 25.08.2036 | | 10.446 | | 5.217 | 0,04 |
| 4,552 % fällig am 25.08.2035 | | 259 | | 263 | 0,00 |
| 4,810 % fällig am 25.05.2035 | | 36 | | 37 | 0,00 |
| 4,820 % fällig am 25.10.2035 | | 22 | | 23 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | | |
| 4,433 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 737 | | 684 | 0,01 |
| 4,550 % fällig am 25.09.2035 | | 543 | | 558 | 0,00 |
| 4,680 % fällig am 25.09.2035 | | 35 | | 36 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 4,243 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.331 | | 1.247 | 0,01 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.02.2037 | | 3.232 | | 2.681 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 607 | | 599 | 0,00 |
| **Civic Mortgage LLC** | | | | | |
| 4,349 % fällig am 25.11.2022 | | 2.447 | | 2.445 | 0,02 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | | | |
| 0,698 % fällig am 10.03.2046 (a) | | 21.812 | | 474 | 0,00 |
| 1,493 % fällig am 10.01.2046 (a) | | 16.293 | | 644 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.06.2036 | | 1.972 | | 1.875 | 0,01 |
| 2,563 % fällig am 20.02.2047 ^ | | 9.309 | | 7.392 | 0,05 |
| 2,564 % fällig am 25.02.2047 | | 254 | | 247 | 0,00 |
| 2,578 % fällig am 20.12.2046 ^ | | 4.481 | | 4.056 | 0,03 |
| 2,593 % fällig am 20.03.2046 | | 3.128 | | 2.899 | 0,02 |
| 2,593 % fällig am 20.07.2046 ^ | | 460 | | 364 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.05.2036 | | 123 | | 109 | 0,00 |
| 2,613 % fällig am 20.05.2046 ^ | | 4.474 | | 3.776 | 0,03 |
| 2,614 % fällig am 25.05.2035 | | 60 | | 58 | 0,00 |
| 2,614 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 98 | | 90 | 0,00 |
| 2,634 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 7.758 | | 6.371 | 0,05 |
| 2,663 % fällig am 20.09.2046 | | 1.376 | | 843 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.02.2037 | | 1.601 | | 1.487 | 0,01 |
| 2,713 % fällig am 20.11.2035 | | 57 | | 56 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.11.2035 | | 17 | | 16 | 0,00 |
| 2,744 % fällig am 25.10.2046 ^ | | 870 | | 578 | 0,00 |
| 2,754 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 773 | | 400 | 0,00 |
| 3,023 % fällig am 20.11.2035 | | 982 | | 944 | 0,01 |
| 3,154 % fällig am 25.07.2036 | | 452 | | 303 | 0,00 |
| 3,174 % fällig am 25.11.2035 | | 432 | | 423 | 0,00 |
| 4,004 % fällig am 25.11.2035 | | 582 | | 541 | 0,00 |
| 4,271 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 43 | | 38 | 0,00 |
| 4,544 % fällig am 25.11.2035 | | 450 | | 431 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 331 | | 314 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.552 | | 1.503 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 305 | | 261 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 248 | | 175 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 217 | | 195 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 664 | | 554 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2032 | | 31 | | 33 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,754 % fällig am 25.02.2036 ^ | $ 74 | $ 18 | 0,00 |
| 2,862 % fällig am 25.04.2035 | 255 | 234 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.05.2035 | 748 | 694 | 0,01 |
| 2,984 % fällig am 25.04.2035 | 87 | 85 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | 2.215 | 2.104 | 0,02 |
| 3,064 % fällig am 25.02.2035 | 427 | 427 | 0,00 |
| 3,084 % fällig am 25.02.2035 | 173 | 167 | 0,00 |
| 3,164 % fällig am 25.09.2034 | 60 | 60 | 0,00 |
| 3,841 % fällig am 20.02.2036 ^ | 81 | 70 | 0,00 |
| 3,927 % fällig am 25.08.2034 ^ | 56 | 54 | 0,00 |
| 3,991 % fällig am 25.09.2033 ^ | 14 | 13 | 0,00 |
| 4,178 % fällig am 25.08.2034 ^ | 97 | 98 | 0,00 |
| 4,209 % fällig am 20.04.2036 | 2.700 | 2.523 | 0,02 |
| 4,280 % fällig am 25.11.2034 | 331 | 334 | 0,00 |
| 4,366 % fällig am 19.01.2034 | 38 | 40 | 0,00 |
| 4,592 % fällig am 20.02.2036 ^ | 117 | 107 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | 157 | 140 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2037 ^ | 648 | 548 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | 611 | 517 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 | 1.632 | 1.263 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037 | 879 | 674 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2047 | 665 | 550 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | |
| 2,764 % fällig am 25.03.2035 ^ | 1.563 | 1.455 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2035 ^ | 87 | 88 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 3,133 % fällig am 25.03.2032 | 77 | 75 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.04.2033 | 15 | 16 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-through Certificates** | | | |
| 4,201 % fällig am 25.07.2033 | 19 | 19 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 4,249 % fällig am 25.06.2050 | 5.048 | 3.925 | 0,03 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,579 % fällig am 25.04.2037 ^ | 83 | 40 | 0,00 |
| **DBUBS Mortgage Trust** | | | |
| 0,885 % fällig am 10.11.2046 (a) | 3.762 | 22 | 0,00 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.08.2036 ^ | 3.259 | 3.087 | 0,02 |
| 2,554 % fällig am 25.03.2037 ^ | 3.260 | 3.078 | 0,02 |
| 2,594 % fällig am 25.08.2047 | 5.734 | 5.379 | 0,04 |
| 2,704 % fällig am 25.09.2047 ^ | 4.901 | 4.440 | 0,03 |
| 2,734 % fällig am 25.08.2037 ^ | 5.603 | 4.861 | 0,04 |
| 3,739 % fällig am 25.10.2035 | 161 | 143 | 0,00 |
| **Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,504 % fällig am 25.10.2036 ^ | 13 | 10 | 0,00 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,580 % fällig am 19.10.2036 | 2.248 | 2.012 | 0,02 |
| 3,230 % fällig am 19.09.2044 | 61 | 61 | 0,00 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | |
| 4,278 % fällig am 25.04.2035 | 176 | 179 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | 239 | 164 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 ^ | 262 | 200 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 4,518 % fällig am 25.08.2035 | 116 | 97 | 0,00 |
| **GRACE Mortgage Trust** | | | |
| 3,369 % fällig am 10.06.2028 | 650 | 663 | 0,01 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.01.2037 | 1.075 | 1.032 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.04.2036 | 742 | 710 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.04.2036 ^ | 77 | 245 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.09.2046 ^ | 1.014 | 784 | 0,01 |
| 2,744 % fällig am 25.10.2046 ^ | 1.284 | 1.004 | 0,01 |
| 2,844 % fällig am 25.06.2045 | 107 | 102 | 0,00 |
| 2,944 % fällig am 25.11.2045 | 170 | 151 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates** | | | |
| 5,213 % fällig am 25.10.2033 | 22 | 22 | 0,00 |
| **GS Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 1,657 % fällig am 10.02.2046 (a) | 13.715 | 628 | 0,01 |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,111 % fällig am 10.11.2045 (a) | 62.575 | 3.424 | 0,03 |
| **GSMSC Pass-Through Trust** | | | |
| 7,500 % fällig am 25.10.2036 | 62 | 42 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,919 % fällig am 25.06.2034 | 45 | 45 | 0,00 |
| 4,040 % fällig am 25.04.2032 | 197 | 180 | 0,00 |
| 4,300 % fällig am 25.03.2033 | $ 103 | $ 104 | 0,00 |
| 4,396 % fällig am 25.01.2036 ^ | 99 | 100 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 25.09.2035 | 103 | 106 | 0,00 |
| 4,716 % fällig am 25.11.2035 | 78 | 79 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2037 | 650 | 721 | 0,01 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,580 % fällig am 19.09.2037 | 965 | 938 | 0,01 |
| 2,590 % fällig am 19.09.2046 ^ | 1.346 | 1.247 | 0,01 |
| 2,630 % fällig am 19.03.2036 ^ | 252 | 240 | 0,00 |
| 2,890 % fällig am 19.01.2036 | 521 | 417 | 0,00 |
| 3,090 % fällig am 19.01.2035 | 221 | 198 | 0,00 |
| 3,354 % fällig am 19.12.2036 ^ | 616 | 608 | 0,01 |
| 3,890 % fällig am 19.10.2035 | 375 | 327 | 0,00 |
| 4,422 % fällig am 19.07.2035 ^ | 94 | 90 | 0,00 |
| 4,504 % fällig am 19.10.2035 | 600 | 466 | 0,00 |
| 4,526 % fällig am 19.08.2036 ^ | 256 | 245 | 0,00 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.12.2036 | 26 | 26 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.10.2035 | 1.413 | 1.428 | 0,01 |
| 2,734 % fällig am 25.10.2035 | 400 | 406 | 0,00 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | 138 | 126 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 3,404 % fällig am 25.07.2033 | 23 | 22 | 0,00 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | |
| 2,664 % fällig am 25.01.2037 | 8.162 | 6.995 | 0,05 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.02.2037 ^ | 2.763 | 2.687 | 0,02 |
| 2,604 % fällig am 25.06.2046 | 1.918 | 1.693 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.06.2037 | 247 | 245 | 0,00 |
| 3,422 % fällig am 25.03.2036 | 941 | 878 | 0,01 |
| 3,736 % fällig am 25.06.2036 | 286 | 278 | 0,00 |
| 3,761 % fällig am 25.10.2035 | 152 | 137 | 0,00 |
| 3,772 % fällig am 25.01.2036 ^ | 154 | 138 | 0,00 |
| 3,926 % fällig am 25.08.2035 ^ | 169 | 154 | 0,00 |
| 3,981 % fällig am 25.03.2036 ^ | 3.244 | 2.985 | 0,02 |
| 4,290 % fällig am 25.12.2034 | 100 | 100 | 0,00 |
| **JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 0,955 % fällig am 15.04.2047 (a) | 38.557 | 902 | 0,01 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,644 % fällig am 25.10.2036 | 5.912 | 5.798 | 0,04 |
| 4,396 % fällig am 25.12.2035 ^ | 1.209 | 1.065 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | 13 | 9 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,130 % fällig am 15.12.2047 (a) | 73.215 | 2.180 | 0,02 |
| 4,070 % fällig am 15.11.2043 | 86 | 87 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 4,184 % fällig am 25.08.2034 | 284 | 286 | 0,00 |
| 4,304 % fällig am 25.02.2036 ^ | 257 | 215 | 0,00 |
| 4,323 % fällig am 25.11.2033 | 126 | 130 | 0,00 |
| 4,346 % fällig am 25.06.2036 ^ | 466 | 430 | 0,00 |
| 4,488 % fällig am 25.12.2034 | 483 | 499 | 0,00 |
| 4,586 % fällig am 25.02.2036 ^ | 782 | 710 | 0,01 |
| 4,686 % fällig am 25.07.2035 | 98 | 99 | 0,00 |
| 4,697 % fällig am 25.07.2035 | 284 | 291 | 0,00 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | |
| 2,604 % fällig am 25.10.2046 | 760 | 749 | 0,01 |
| 2,764 % fällig am 25.12.2036 ^ | 627 | 598 | 0,00 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | |
| 4,663 % fällig am 21.11.2034 | 231 | 241 | 0,00 |
| **MASTR Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,804 % fällig am 25.03.2036 ^ | 693 | 134 | 0,00 |
| **MASTR Asset Securitization Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | 370 | 359 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 3,094 % fällig am 15.11.2031 | 142 | 143 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,834 % fällig am 15.12.2030 | 147 | 144 | 0,00 |
| 3,141 % fällig am 20.10.2029 | 43 | 43 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | 11.131 | 5.413 | 0,04 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 3,064 % fällig am 25.06.2028 | 45 | 45 | 0,00 |
| 4,358 % fällig am 25.12.2034 | 356 | 362 | 0,00 |
| 4,483 % fällig am 25.02.2033 | 150 | 147 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 25.06.2037 | 157 | 160 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,306 % fällig am 25.04.2037 ^ | $ 1.173 | $ 1.183 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust** | | | |
| 1,125 % fällig am 15.12.2048 (a) | 52.022 | 1.457 | 0,01 |
| 1,487 % fällig am 15.02.2046 (a) | 55.195 | 2.232 | 0,02 |
| 1,615 % fällig am 15.08.2045 (a) | 7.003 | 249 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,664 % fällig am 25.04.2035 | 722 | 716 | 0,01 |
| 3,703 % fällig am 25.11.2037 | 846 | 724 | 0,01 |
| 4,452 % fällig am 25.11.2035 ^ | 76 | 69 | 0,00 |
| **MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,634 % fällig am 25.06.2047 | 8.049 | 7.866 | 0,06 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | |
| 4,099 % fällig am 25.10.2035 | 54 | 55 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 1,836 % fällig am 25.09.2046 | 1.732 | 841 | 0,01 |
| **OBP Depositor LLC Trust** | | | |
| 4,646 % fällig am 15.07.2045 | 300 | 303 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.06.2037 ^ | 2.926 | 2.581 | 0,02 |
| 2,554 % fällig am 25.02.2047 | 602 | 349 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.03.2047 | 3.206 | 3.106 | 0,02 |
| 2,584 % fällig am 25.06.2046 | 5.563 | 2.239 | 0,02 |
| 2,614 % fällig am 25.04.2046 | 4.317 | 1.997 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.08.2037 | 1.185 | 1.132 | 0,01 |
| 3,752 % fällig am 25.11.2037 | 3.097 | 2.882 | 0,02 |
| 4,240 % fällig am 25.08.2035 ^ | 50 | 32 | 0,00 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 2,804 % fällig am 25.01.2046 ^ | 14 | 6 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.03.2035 | 912 | 817 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | 3.001 | 2.996 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2037 ^ | 1.446 | 1.164 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | 856 | 559 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.10.2036 ^ | 866 | 888 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2036 ^ | 1.133 | 600 | 0,00 |
| 6,628 % fällig am 25.05.2036 | 1.377 | 928 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | |
| 4,485 % fällig am 25.09.2035 ^ | 345 | 287 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2032 | 12 | 12 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,733 % fällig am 20.07.2033 | 343 | 338 | 0,00 |
| 3,090 % fällig am 19.10.2026 | 63 | 64 | 0,00 |
| 3,143 % fällig am 20.10.2027 | 6 | 6 | 0,00 |
| 3,808 % fällig am 20.01.2047 ^ | 566 | 460 | 0,00 |
| 4,044 % fällig am 20.07.2037 | 1.553 | 1.471 | 0,01 |
| 4,807 % fällig am 20.04.2035 | 102 | 108 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | 18 | 17 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.10.2035 | 764 | 740 | 0,01 |
| 3,874 % fällig am 25.11.2035 ^ | 125 | 119 | 0,00 |
| 4,246 % fällig am 25.07.2035 ^ | 1.669 | 1.578 | 0,01 |
| 4,329 % fällig am 25.08.2035 | 224 | 227 | 0,00 |
| 4,377 % fällig am 25.12.2035 | 979 | 943 | 0,01 |
| 4,427 % fällig am 25.09.2034 | 248 | 253 | 0,00 |
| 4,469 % fällig am 25.09.2034 | 592 | 609 | 0,01 |
| 4,561 % fällig am 25.09.2034 | 18 | 18 | 0,00 |
| 4,566 % fällig am 25.02.2034 | 158 | 160 | 0,00 |
| 4,714 % fällig am 25.04.2034 | 303 | 316 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.08.2036 | 3.889 | 3.635 | 0,03 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | 2.974 | 2.851 | 0,02 |
| 2,584 % fällig am 25.01.2037 | 4.670 | 4.489 | 0,03 |
| 2,584 % fällig am 25.09.2047 | 3.486 | 3.365 | 0,02 |
| 2,594 % fällig am 25.06.2036 | 188 | 189 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.10.2036 | 6.985 | 6.482 | 0,05 |
| 2,614 % fällig am 25.05.2036 | 1.135 | 1.071 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.09.2047 ^ | 3.823 | 3.919 | 0,03 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2036 | 4.521 | 4.270 | 0,03 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2046 | 3.658 | 2.092 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2047 | 50 | 48 | 0,00 |
| 2,640 % fällig am 19.07.2035 | 87 | 86 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.05.2046 ^ | 33 | 53 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.02.2036 ^ | 782 | 751 | 0,01 |
| 2,970 % fällig am 19.07.2034 | 51 | 51 | 0,00 |
| 3,050 % fällig am 19.09.2032 | 61 | 61 | 0,00 |
| 3,090 % fällig am 19.03.2034 | 11 | 11 | 0,00 |
| 3,468 % fällig am 25.05.2047 ^ | 3.923 | 3.567 | 0,03 |
| 3,904 % fällig am 25.12.2035 ^ | 161 | 166 | 0,00 |
| 4,004 % fällig am 25.08.2047 ^ | 2.033 | 1.997 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | |
| 2,684 % fällig am 25.01.2036 | $ 16 | $ 15 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,694 % fällig am 25.10.2036 | 764 | 679 | 0,01 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,630 % fällig am 25.01.2037 ^ | 38 | 20 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 3,402 % fällig am 25.06.2037 | 3.117 | 2.892 | 0,02 |
| 3,452 % fällig am 25.06.2037 | 2.603 | 2.468 | 0,02 |
| 3,452 % fällig am 25.06.2047 ^ | 2.291 | 2.153 | 0,02 |
| 3,452 % fällig am 25.06.2047 | 43 | 39 | 0,00 |
| 3,502 % fällig am 25.03.2037 ^ | 1.411 | 1.313 | 0,01 |
| 3,654 % fällig am 25.06.2037 ^ | 1.610 | 1.531 | 0,01 |
| 4,131 % fällig am 25.09.2037 | 91 | 92 | 0,00 |
| **UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 1,093 % fällig am 10.03.2046 (a) | 91.109 | 2.612 | 0,02 |
| 1,783 % fällig am 10.12.2045 (a) | 84.455 | 3.732 | 0,03 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,345 % fällig am 27.02.2034 | 182 | 182 | 0,00 |
| 2,345 % fällig am 25.01.2047 | 660 | 658 | 0,01 |
| 2,595 % fällig am 25.10.2046 | 19 | 18 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.12.2045 | 37 | 37 | 0,00 |
| 2,694 % fällig am 25.10.2045 | 197 | 197 | 0,00 |
| 2,714 % fällig am 25.01.2045 | 474 | 472 | 0,00 |
| 2,814 % fällig am 25.11.2045 | 581 | 578 | 0,00 |
| 2,814 % fällig am 25.12.2045 | 458 | 447 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.04.2045 | 43 | 43 | 0,00 |
| 2,984 % fällig am 25.07.2045 | 431 | 429 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 25.01.2045 | 105 | 105 | 0,00 |
| 3,144 % fällig am 25.11.2034 | 356 | 359 | 0,00 |
| 3,292 % fällig am 25.12.2046 | 46 | 46 | 0,00 |
| 3,384 % fällig am 25.10.2046 ^ | 4.260 | 4.025 | 0,03 |
| 3,484 % fällig am 25.06.2046 | 1.286 | 1.277 | 0,01 |
| 3,492 % fällig am 25.05.2037 ^ | 1.897 | 1.590 | 0,01 |
| 3,504 % fällig am 25.02.2046 | 3.172 | 3.244 | 0,02 |
| 3,504 % fällig am 25.08.2046 | 188 | 176 | 0,00 |
| 3,651 % fällig am 25.03.2036 ^ | 1.813 | 1.672 | 0,01 |
| 3,683 % fällig am 25.12.2036 ^ | 858 | 817 | 0,01 |
| 3,704 % fällig am 25.11.2042 | 71 | 70 | 0,00 |
| 3,847 % fällig am 25.09.2036 ^ | 1.255 | 1.213 | 0,01 |
| 3,884 % fällig am 25.08.2035 | 76 | 75 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.08.2042 | 1 | 1 | 0,00 |
| 3,981 % fällig am 25.05.2037 ^ | 3.573 | 3.494 | 0,03 |
| 3,998 % fällig am 25.09.2036 | 473 | 461 | 0,00 |
| 4,229 % fällig am 25.03.2036 | 133 | 131 | 0,00 |
| 4,243 % fällig am 25.12.2035 | 540 | 540 | 0,00 |
| 4,292 % fällig am 25.08.2034 | 165 | 171 | 0,00 |
| 4,380 % fällig am 25.09.2033 | 44 | 46 | 0,00 |
| 4,541 % fällig am 25.03.2033 | 19 | 20 | 0,00 |
| 4,697 % fällig am 25.06.2033 | 83 | 85 | 0,00 |
| 4,814 % fällig am 25.03.2034 | 11 | 12 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,654 % fällig am 25.07.2046 ^ | 14 | 10 | 0,00 |
| 2,854 % fällig am 25.04.2035 | 250 | 205 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.07.2036 ^ | 127 | 87 | 0,00 |
| 3,444 % fällig am 25.07.2046 ^ | 661 | 490 | 0,00 |
| 4,278 % fällig am 25.06.2033 | 11 | 11 | 0,00 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | |
| 4,721 % fällig am 28.12.2037 ^ | 750 | 748 | 0,01 |
| **Wells Fargo Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 1,933 % fällig am 15.10.2045 (a) | 18.186 | 848 | 0,01 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,843 % fällig am 25.06.2035 | 120 | 123 | 0,00 |
| 4,901 % fällig am 25.12.2033 | 4 | 4 | 0,00 |
| 4,905 % fällig am 25.10.2035 | 427 | 438 | 0,00 |
| 4,934 % fällig am 25.04.2036 | 56 | 56 | 0,00 |
| 4,990 % fällig am 25.03.2036 | 110 | 110 | 0,00 |
| 4,991 % fällig am 25.03.2036 | 122 | 126 | 0,00 |
| 4,991 % fällig am 25.03.2036 ^ | 2.054 | 2.059 | 0,02 |
| 4,992 % fällig am 25.07.2036 ^ | 253 | 258 | 0,00 |
| 5,085 % fällig am 25.03.2035 | 164 | 169 | 0,00 |
| 5,178 % fällig am 25.07.2036 ^ | 737 | 749 | 0,01 |
| | | 315.743 | 2,27 |

## US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,645 % fällig am 25.08.2022 (a) | 60.349 | 824 | 0,01 |
| 0,744 % fällig am 25.05.2022 (a) | 90.599 | 1.349 | 0,01 |
| 2,355 % fällig am 25.01.2022 (a) | 19.211 | 487 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.03.2034 | $ 139 | $ 138 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.08.2034 | 48 | 47 | 0,00 |
| 2,570 % fällig am 25.12.2036 | 469 | 464 | 0,00 |
| 2,754 % fällig am 25.03.2044 | 11 | 11 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.06.2029 - 25.06.2036 | 615 | 616 | 0,01 |
| 2,827 % fällig am 25.09.2042 | 66 | 65 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.11.2040 | 1.718 | 1.725 | 0,01 |
| 3,004 % fällig am 25.11.2020 | 9 | 9 | 0,00 |
| 3,054 % fällig am 25.09.2023 | 8 | 8 | 0,00 |
| 3,490 % fällig am 01.12.2020 | 82.984 | 84.376 | 0,61 |
| 3,682 % fällig am 01.11.2042 - 01.10.2044 | 116 | 117 | 0,00 |
| 3,820 % fällig am 01.09.2021 | 458 | 472 | 0,00 |
| 3,882 % fällig am 01.09.2040 | 39 | 39 | 0,00 |
| 3,980 % fällig am 01.07.2021 | 1.100 | 1.139 | 0,01 |
| 4,034 % fällig am 01.10.2034 | 15 | 16 | 0,00 |
| 4,170 % fällig am 01.04.2033 | 70 | 72 | 0,00 |
| 4,208 % fällig am 01.01.2033 | 34 | 35 | 0,00 |
| 4,220 % fällig am 01.10.2034 | 41 | 42 | 0,00 |
| 4,291 % fällig am 01.12.2034 | 72 | 75 | 0,00 |
| 4,295 % fällig am 01.06.2021 | 911 | 947 | 0,01 |
| 4,307 % fällig am 01.04.2033 | 85 | 88 | 0,00 |
| 4,314 % fällig am 01.08.2033 | 29 | 30 | 0,00 |
| 4,356 % fällig am 01.09.2037 | 68 | 71 | 0,00 |
| 4,393 % fällig am 25.05.2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,520 % fällig am 01.06.2035 | 34 | 36 | 0,00 |
| 4,545 % fällig am 01.08.2035 | 88 | 91 | 0,00 |
| 4,633 % fällig am 01.06.2030 | 9 | 9 | 0,00 |
| 4,665 % fällig am 01.08.2036 | 3 | 4 | 0,00 |
| 4,743 % fällig am 01.11.2034 | 711 | 754 | 0,01 |
| 4,947 % fällig am 01.12.2030 | 4 | 4 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044 | 1.129 | 1.294 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 01.11.2036 - 01.08.2037 | 185 | 197 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 01.11.2036 | 84 | 87 | 0,00 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2030 | 185 | 273 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.05.2030 - 01.06.2031 | 7.576 | 7.640 | 0,06 |
| 3,000 % fällig am 01.01.2027 | 65 | 67 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.01.2026 - 01.09.2048 | 59.148 | 61.263 | 0,44 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2023 - 01.03.2046 | 4.284 | 4.548 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2020 - 01.03.2022 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.06.2023 - 01.11.2039 | 102 | 110 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 01.06.2036 - 01.06.2037 | 20 | 24 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 54.200 | 54.622 | 0,39 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2034 - 01.08.2049 | 2.261.600 | 2.312.184 | 16,60 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 1.105.400 | 1.142.408 | 8,20 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2049 | 5.500 | 5.746 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2049 | 3.000 | 3.200 | 0,02 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,953 % fällig am 25.09.2022 (a) | 36.710 | 854 | 0,01 |
| 1,112 % fällig am 25.11.2022 (a) | 35.371 | 992 | 0,01 |
| 1,520 % fällig am 25.11.2019 (a) | 49.529 | 179 | 0,00 |
| 1,658 % fällig am 25.06.2020 (a) | 44.825 | 471 | 0,00 |
| 1,694 % fällig am 25.08.2019 (a) | 29.603 | 46 | 0,00 |
| 2,534 % fällig am 25.08.2031 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,710 % fällig am 25.09.2031 | 95 | 94 | 0,00 |
| 2,844 % fällig am 15.12.2031 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 15.10.2040 | 3.756 | 3.765 | 0,03 |
| 2,894 % fällig am 15.06.2041 | 5.768 | 5.789 | 0,04 |
| 2,994 % fällig am 15.12.2037 | 163 | 165 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.11.2026 - 01.04.2045 | 1.147 | 1.165 | 0,01 |
| 3,488 % fällig am 25.02.2045 | 136 | 136 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2026 - 01.04.2049 | 63.315 | 65.057 | 0,47 |
| 3,704 % fällig am 25.10.2044 | 1.916 | 1.936 | 0,01 |
| 3,904 % fällig am 25.07.2044 | 48 | 49 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.09.2024 - 01.09.2041 | $ 20 | $ 20 | 0,00 |
| 4,384 % fällig am 01.10.2034 | 31 | 32 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2035 | 85 | 89 | 0,00 |
| 4,521 % fällig am 01.09.2035 | 45 | 47 | 0,00 |
| 4,626 % fällig am 01.10.2033 | 42 | 45 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.08.2035 - 01.12.2039 | 1.158 | 1.275 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 01.06.2037 - 01.10.2039 | 81 | 88 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2036 | 2.891 | 3.328 | 0,02 |
| 7,000 % fällig am 01.10.2037 | 9 | 10 | 0,00 |
| **Freddie Mac, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2049 | 22.900 | 23.111 | 0,17 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 58.500 | 60.505 | 0,44 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 3,259 % fällig am 20.01.2066 | 2.880 | 2.897 | 0,02 |
| 3,297 % fällig am 20.08.2066 | 7.124 | 7.190 | 0,05 |
| 3,625 % fällig am 20.04.2027 - 20.05.2030 | 33 | 34 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 20.09.2023 - 20.09.2026 | 15 | 15 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 20.01.2025 - 20.01.2030 | 8 | 8 | 0,00 |
| 4,125 % fällig am 20.11.2026 | 1 | 1 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.04.2039 | 73 | 80 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 20.04.2038 | 32 | 36 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 20.08.2035 - 15.02.2039 | 399 | 441 | 0,00 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 80.000 | 82.581 | 0,59 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 105.100 | 108.926 | 0,78 |
| **NCUA Guaranteed Notes** | | | |
| 2,979 % fällig am 08.12.2020 | 324 | 326 | 0,00 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 4,233 % fällig am 10.09.2019 | 32 | 32 | 0,00 |
| 4,760 % fällig am 01.09.2025 | 39 | 40 | 0,00 |
| 4,840 % fällig am 01.05.2025 | 24 | 25 | 0,00 |
| 5,090 % fällig am 01.10.2025 | 24 | 25 | 0,00 |
| 5,110 % fällig am 01.04.2025 | 5 | 5 | 0,00 |
| 5,490 % fällig am 01.05.2028 | 38 | 42 | 0,00 |
| 5,600 % fällig am 01.09.2028 | 17 | 19 | 0,00 |
| 5,980 % fällig am 01.05.2022 | 2 | 2 | 0,00 |
| 6,220 % fällig am 01.12.2028 | 127 | 140 | 0,00 |
| 7,060 % fällig am 01.11.2019 | 1 | 1 | 0,00 |
| 7,220 % fällig am 01.11.2020 | 34 | 35 | 0,00 |
| **Tennessee Valley Authority** | | | |
| 5,880 % fällig am 01.04.2036 | 500 | 690 | 0,01 |
| **U.S. Small Business Administration** | | | |
| 5,680 % fällig am 01.06.2028 | 12 | 13 | 0,00 |
| | | 4.060.680 | 29,14 |

## US-SCHATZOBLIGATIONEN

| | | | |
|---|---|---|---|
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 | 4.700 | 5.141 | 0,04 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 | 400 | 438 | 0,00 |
| 3,125 % fällig am 15.02.2043 (k) | 27.000 | 30.115 | 0,22 |
| 3,625 % fällig am 15.08.2043 (k) | 14.400 | 17.385 | 0,12 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.01.2022 | 6.322 | 6.284 | 0,04 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 | 51.480 | 51.087 | 0,37 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 | 699 | 698 | 0,01 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | 1.294 | 1.296 | 0,01 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 248 | 251 | 0,00 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | 37.020 | 37.289 | 0,27 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | 136 | 137 | 0,00 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | 189.971 | 193.142 | 1,39 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | 6.161 | 6.312 | 0,04 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | 7.838 | 8.170 | 0,06 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | 1.085 | 1.075 | 0,01 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | 2.206 | 2.323 | 0,02 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | 83.097 | 87.506 | 0,63 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | 1.096 | 1.245 | 0,01 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | 21.587 | 24.211 | 0,17 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 13.646 | 15.189 | 0,11 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 | 1.220 | 1.364 | 0,01 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2027 | 1.267 | 1.464 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | 47.959 | 57.719 | 0,41 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | 30.774 | 41.216 | 0,29 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,000 % fällig am 30.11.2022 (k) | $ | 5.228 | $ 5.276 | 0,04 |
| 2,000 % fällig am 30.04.2024 | | 2.650 | 2.679 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 (k) | | 1.100 | 1.111 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2027 (k) | | 1.165 | 1.193 | 0,01 |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 | | 350 | 362 | 0,00 |
| 2,625 % fällig am 15.06.2021 | | 6.300 | 6.406 | 0,04 |
| 2,625 % fällig am 31.12.2025 | | 150 | 157 | 0,00 |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 (k) | | 1.055 | 1.113 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 30.09.2023 (k) | | 1.010 | 1.057 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 30.04.2025 (k) | | 212.500 | 224.934 | 1,61 |
| 3,125 % fällig am 15.11.2028 (k) | | 1.340 | 1.470 | 0,01 |
| | | | 836.815 | 6,00 |
| Summe USA | | | 6.954.085 | 49,91 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE PENSIONSGESCHÄFTE (k)** | | | | |
| | | | 6.918 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **South Africa Treasury Bills** | | | | |
| 7,511 % fällig am 04.12.2019 (d)(e) | ZAR | 732.330 | $ 50.499 | 0,36 |
| **ITALY TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,213) % fällig am 12.07.2019 (d)(e) | € | 100.000 | 113.889 | 0,82 |
| (0,198) % fällig am 12.07.2019 (d)(e) | | 73.600 | 83.822 | 0,60 |
| (0,198) % fällig am 31.07.2019 (d)(e) | | 20.700 | 23.579 | 0,17 |
| (0,152) % fällig am 14.08.2019 (d)(e) | | 65.000 | 74.044 | 0,53 |
| | | | 295.334 | 2,12 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,197) % fällig am 01.07.2019 (d)(e) | ¥ | 10.509.000 | 97.540 | 0,70 |
| (0,174) % fällig am 29.07.2019 (d)(e) | | 14.363.000 | 133.324 | 0,96 |
| (0,170) % fällig am 29.07.2019 (d)(e) | | 2.902.000 | 26.938 | 0,20 |
| (0,166) % fällig am 29.07.2019 (d)(e) | ¥ | 150.000 | $ 1.392 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| (0,153) % fällig am 19.08.2019 (d)(e) | 42.510.000 | 394.627 | 2,83 |
| (0,144) % fällig am 16.07.2019 (d)(e) | 9.790.000 | 90.872 | 0,65 |
| | | 744.693 | 5,35 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 1.097.444 | 7,88 |
| | | **AKTIEN** | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)** | 5.022.735 | 50.302 | 0,36 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 17.884.344** | **128,37** |

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablauf-monat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 4.086 | $ 564 | 0,01 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 106 | (64) | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 15 | 31 | 0,00 |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09/2019 | 3.988 | 2.456 | 0,02 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2019 | 1.235 | (6.720) | (0,05) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 607 | (1.034) | (0,01 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 419 | 2.677 | 0,02 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 6.479 | (25.214) | (0,18) |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09/2019 | 377 | (86) | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 10.426 | 16.760 | 0,12 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 14.395 | 30.920 | 0,22 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 1.783 | 11.480 | 0,08 |
| United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate September Futures | Long | 09/2019 | 15.974 | 9.116 | 0,07 |
| United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate September Futures | Short | 09/2020 | 15.974 | (16.555) | (0,12) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 709 | 63 | 0,00 |
| | | | | $ 24.394 | 0,18 |

## OPTIONSKAUF

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | $ 110,500 | 23.08.2019 | 1.693 | $ 14 | $ 2 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 111,500 | 23.08.2019 | 2.459 | 21 | 2 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,000 | 23.08.2019 | 8.174 | 70 | 8 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,500 | 23.08.2019 | 581 | 5 | 1 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 114,000 | 23.08.2019 | 882 | 8 | 1 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 107,000 | 23.08.2019 | 1.840 | 16 | 2 | 0,00 |
| | | | | $ 134 | $ 16 | 0,00 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 127,000 | 26.07.2019 | 863 | $ (349) | $ (1.052) | (0,01) |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 125,500 | 26.07.2019 | 1.706 | (573) | (80) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 1.706 | (596) | (453) | 0,00 |
| | | | | $ (1.518) | $ (1.585) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 22.825** | **0,17** |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global 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-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| BASF SE | (1,000) % | 20.12.2020 | € 5.700 | $ 90 | 0,00 |
| Fortum Oyj | (1,000) | 20.12.2020 | 800 | 10 | 0,00 |
| Reynolds American, Inc. | (1,000) | 20.12.2020 | $ 16.900 | 235 | 0,00 |
| United Utilities PLC | (1,000) | 20.12.2020 | € 2.200 | 23 | 0,00 |
| | | | | $ 358 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Daimler AG | 1,000 % | 20.12.2020 | € 3.800 | $ (7) | 0,00 |
| Ryder System, Inc. | 1,000 | 20.06.2022 | $ 1.800 | (16) | 0,00 |
| Shell International Finance BV | 1,000 | 20.12.2026 | € 8.900 | 114 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2022 | 6.750 | 127 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2025 | 2.900 | 55 | 0,00 |
| | | | | $ 273 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-29 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2023 | $ 2.060 | $ (4) | 0,00 |
| CDX.EM-30 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2023 | 15.000 | 273 | 0,00 |
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 211.800 | 2.853 | 0,02 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 894.100 | 2.361 | 0,02 |
| iTraxx Crossover 31 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2024 | € 25.600 | 135 | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 437.600 | 1.630 | 0,01 |
| | | | | $ 7.248 | 0,05 |

**ZINSSWAPS - BASISSWAPS**

| Zahlung variabler Zinssatzindex | Erhalt variabler Zinssatzindex | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,117 % | 02.03.2020 | $ 852.500 | $ 247 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,091 % | 18.03.2022 | 3.216.900 | 344 | 0,01 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,084 % | 26.04.2022 | 538.800 | 105 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,070 % | 12.06.2022 | 87.800 | 99 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,084 % | 12.06.2022 | 80.500 | 58 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,085 % | 19.06.2022 | 405.400 | 312 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,086 % | 12.04.2023 | 288.800 | 66 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,073 % | 27.04.2023 | 339.800 | 64 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 0,088 % | 23.05.2029 | 169.100 | (38) | 0,00 |
| | | | | $ 1.257 | 0,01 |

**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 | 2,673 % | 30.04.2025 | $ 21.400 | $ (1.363) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,683 | 30.04.2025 | 69.700 | (4.511) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,684 | 30.04.2025 | 32.200 | (2.071) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,696 | 30.04.2025 | 22.100 | (1.437) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,710 | 30.04.2025 | 26.100 | (1.719) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,714 | 30.04.2025 | 35.400 | (2.339) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,370 | 02.01.2020 | BRL 2.291.900 | (1.043) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,450 | 02.01.2020 | 3.706.200 | (2.232) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,880 | 04.01.2021 | 17.000 | 252 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,850 | 15.09.2027 | CAD 1.600 | 60 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,500 | 19.06.2029 | 456.900 | 15.881 | 0,11 |
| Zahlung | 3-Month PLN-WIBOR | 2,405 | 30.01.2029 | PLN 24.200 | 193 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 0,500 | 19.06.2024 | SEK 260.100 | (24) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 20.06.2020 | $ 652.400 | (10.881) | (0,08) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 73.000 | (12.412) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2020 | 110.500 | (2.276) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 88.300 | (7.572) | (0,05) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,955 | 12.11.2049 | 60.300 | (6.582) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2021 | 186.400 | 1.999 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 56.000 | 1.019 | 0,01 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 % | 19.06.2026 | $ 153.300 | $ (7.453) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 599.750 | (30.296) | (0,22) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 96.600 | (19.202) | (0,14) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,250 | 20.06.2023 | ZAR 263.900 | 148 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,912 | 30.01.2029 | CZK 158.300 | 201 | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.09.2021 | € 1.265.600 | (3.544) | (0,02) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2021 | 1.092.800 | (719) | (0,01) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2024 | 325.211 | 1.580 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | 524.000 | 11.971 | 0,09 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 19.06.2024 | 0 | 0 | 0,00 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 18.12.2029 | 577.050 | 6.294 | 0,05 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | 468.100 | 22.169 | 0,16 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 08.03.2029 | 230.600 | 7.394 | 0,05 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | 10.425 | (1.719) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | 14.300 | (2.307) | (0,02) |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,310 | 19.06.2029 | 561.400 | 5.513 | 0,04 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.09.2021 | £ 210.700 | 1.666 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2029 | 67.600 | (250) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.12.2049 | 7.100 | (133) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.12.2020 | 247.600 | 1.597 | 0,01 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 16.12.2021 | 247.600 | (2.178) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 19.06.2024 | 373.600 | 7.463 | 0,05 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2029 | 20.200 | 955 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 9.350 | 725 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,000 | 19.06.2021 | ¥ 16.400.000 | (199) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,200 | 19.06.2029 | 19.660.000 | (1.502) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,400 | 19.06.2039 | 13.160.000 | (3.033) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,500 | 19.06.2049 | 9.330.000 | 3.370 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,825 | 12.01.2023 | MXN 306.900 | 613 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,740 | 22.02.2027 | 163.500 | 40 | 0,00 |
| | | | | | $ (37.894) | (0,27) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (28.758)** | **(0,21)** |

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

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**DEVISENOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Call - OTC USD versus INR | INR | 82,000 | 16.10.2019 | 17.460 | $ 129 | $ 1 | 0,00 |
| HUS | Call - OTC AUD versus CAD | CAD | 0,940 | 13.09.2019 | 97.900 | 274 | 199 | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus INR | INR | 82,000 | 16.10.2019 | 185.200 | 1.309 | 15 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.712 | $ 215 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 % | 21.08.2019 | 25.900 | $ (31) | $ (5) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 26.700 | (27) | (4) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 29.800 | (33) | (9) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 17.300 | (19) | (4) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 25.200 | (43) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 47.700 | (47) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 37.300 | (44) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 27.700 | (54) | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 25.100 | (25) | (4) | 0,00 |
| | | | | | | $ (323) | $ (46) | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

## DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Put - OTC USD versus COP | COP | 3.165,000 | 29.08.2019 | 46.620 | $ (385) | $ (395) | 0,00 |
| | Put - OTC USD versus ZAR | ZAR | 14,200 | 18.07.2019 | 33.770 | (191) | (533) | (0,01) |
| HUS | Put - OTC AUD versus CAD | CAD | 0,905 | 13.09.2019 | 97.900 | (296) | (383) | 0,00 |
| | Put - OTC USD versus CNH | CNH | 6,795 | 22.07.2019 | 68.560 | (181) | (158) | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus CNH | | 6,945 | 22.07.2019 | 68.560 | (126) | (209) | 0,00 |
| | | | | | | $ (1.179) | $ (1.678) | (0,01) |

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Floor - OTC CPURNSA | $ 217,965 | Maximal [(1 + 0,000 %)$^{10}$ - (Index Final/Index Initial)] oder 0 | 29.09.2020 | 10.500 | $ (135) | $ 0 | 0,00 |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Japan Government International Bond | (1,000) % | 20.06.2022 | $ 5.400 | $ (187) | $ 44 | $ (143) | 0,00 |
| BPS | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 31.100 | (1.113) | 287 | (826) | (0,01) |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 22.300 | (544) | (114) | (658) | 0,00 |
| BRC | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 37.000 | (706) | (263 | (969) | (0,01) |
| | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 14.100 | (487) | 112 | (375) | 0,00 |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 48.550 | (1.225) | (207) | (1.432) | (0,01) |
| CBK | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 21.200 | (751) | 188 | (563) | 0,00 |
| GST | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 10.700 | (207) | (73) | (280) | 0,00 |
| | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 28.800 | (1.019) | 254 | (765) | 0,00 |
| HUS | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 31.800 | (1.077) | 232 | (845) | (0,01) |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 34.100 | (851) | (155) | (1.006) | (0,01) |
| JPM | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 11.200 | (268) | (62) | (330) | 0,00 |
| | | | | | $ (8.435) | $ 243 | $ (8.192) | (0,05) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2023 | $ 1.700 | $ (85) | $ 61 | $ (24) | 0,00 |
| CBK | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 2.000 | (100) | 71 | (29) | 0,00 |
| GST | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 19.300 | (854) | 259 | (595) | (0,01) |
| JPM | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 3.400 | (187) | 138 | (49) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (12) | 7 | (5) | 0,00 |
| | | | | | $ (1.238) | $ 536 | $ (702) | (0,01) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SAL | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 % | 17.08.2061 | $ 29.700 | $ (37) | $ (7) | $ (44) | 0,00 |

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

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

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

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,780 % | 01.05.2029 | ILS 23.600 | $ 0 | $ 199 | $ 199 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,725 | 20.03.2024 | KRW 68.797.000 | 0 | 861 | 861 | 0,01 |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,770 | 20.03.2029 | 2.123.300 | 0 | 59 | 59 | 0,00 |
| BPS | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,180 | 30.01.2024 | ILS 65.000 | 0 | 470 | 470 | 0,01 |

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,755 % | 29.04.2029 | ILS 46.000 | $ 0 | $ 359 | $ 359 | 0,00 |
| GLM | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,779 | 30.04.2029 | 43.200 | 0 | 365 | 365 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,780 | 22.04.2029 | 42.900 | 0 | 369 | 369 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,718 | 19.06.2029 | KRW 15.979.500 | 0 | 380 | 380 | 0,00 |
| HUS | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,785 | 25.04.2029 | ILS 49.800 | 0 | 433 | 433 | 0,01 |
| JPM | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,775 | 25.04.2029 | 47.600 | 23 | 378 | 401 | 0,00 |
| SCX | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,795 | 20.03.2029 | KRW 11.949.000 | 0 | 355 | 355 | 0,00 |
| | | | | | | $ 23 | $ 4.228 | $ 4.251 | 0,03 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | $ 71.000 | 20.03.2020 | $ 431 | $ (2.410) | $ (1.979) | (0,01) |
| GST | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 18.400 | 20.09.2019 | 1 | (1.361) | (1.360) | (0,01) |
| JPM | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 41.000 | 20.09.2019 | 48 | (2.409) | (2.361) | (0,02) |
| MYC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 22.900 | 20.09.2019 | 27 | (1.365) | (1.338) | (0,01) |
| | | | | | | | $ 507 | $ (7.545) | $ (7.038) | (0,05) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 35.529 | $ | 24.595 | $ 0 | $ (338) | $ (338) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 35.765 | | 26.903 | 0 | (467) | (467) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 2.346 | | 2.354 | 0 | (52) | (52) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 1.147.817 | | 175.338 | 206 | 0 | 206 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 38.032 | | 42.510 | 0 | (801) | (801) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 2.247.405 | | 20.745 | 0 | (115) | (115) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 4.475 | | 518 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | SEK | 4.064.776 | | 426.542 | 0 | (11.558) | (11.558) | (0,08) |
| | 07/2019 | SGD | 3 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 125.466 | AUD | 179.849 | 745 | 0 | 745 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 181.804 | CAD | 239.127 | 1.190 | 0 | 1.190 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 14.319 | £ | 11.275 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 74.977 | NZD | 115.127 | 2.350 | 0 | 2.350 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 9.400 | TRY | 54.468 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 49.461 | ZAR | 718.849 | 1.478 | 0 | 1.478 | 0,01 |
| | 08/2019 | AUD | 99.104 | $ | 69.282 | 0 | (341) | (341) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 239.127 | | 181.936 | 0 | (1.193) | (1.193) | (0,01) |
| | 09/2019 | CNH | 1.730.459 | | 249.522 | 0 | (2.141) | (2.141) | (0,02) |
| | 09/2019 | SGD | 7.266 | | 5.308 | 0 | (68) | (68) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 573 | ILS | 2.046 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 3.215.149 | $ | 493.793 | 0 | (526) | (526) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 132.386 | | 4.221 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 37.443 | € | 7.549 | 0 | (177) | (177) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | AUD | 79.707 | $ | 55.499 | 0 | (437) | (437) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 19.172 | | 14.546 | 0 | (126) | (126) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 26.583 | | 27.314 | 48 | (1) | 47 | 0,00 |
| | 07/2019 | CLP | 75.901 | | 112 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 288.917 | | 43.704 | 0 | (379) | (379) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 127.729 | | 143.476 | 4 | (1.993) | (1.989) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 17.191 | | 21.804 | 14 | (89) | (75) | 0,00 |
| | 07/2019 | HKD | 143.580 | | 18.328 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 7.866.583 | | 72.796 | 116 | (340) | (224) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 6.693 | | 768 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 1.104 | | 726 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | RON | 128.598 | | 30.531 | 0 | (423) | (423) | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 2.643.904 | | 40.776 | 0 | (1.062) | (1.062) | (0,01) |
| | 07/2019 | SEK | 53.746 | | 5.700 | 0 | (92) | (92) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 92 | ARS | 4.659 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 10.286 | AUD | 14.832 | 122 | 0 | 122 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.759 | CAD | 2.352 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 9.803 | CLP | 6.781.715 | 189 | 0 | 189 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 16.593 | CNH | 113.671 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 98.663 | € | 87.863 | 1.398 | 0 | 1.398 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 23.107 | £ | 18.271 | 147 | 0 | 147 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 69.055 | ¥ | 7.436.400 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 32.080 | NOK | 274.835 | 155 | 0 | 155 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 21.292 | NZD | 31.920 | 147 | 0 | 147 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 53.334 | SEK | 494.735 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 11.278 | $ | 14.326 | 0 | (49) | (49) | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 376.102 | | 19.018 | 0 | (422) | (422) | 0,00 |
| | 08/2019 | NZD | 31.920 | | 21.305 | 0 | (149 | (149) | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | $ | 388 | MXN | 7.739 | $ 12 | $ 0 | $ 12 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 390 | RUB | 25.496 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 1.917.421 | $ | 1.628 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 09/2019 | TRY | 1.313 | € | 193 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 112 | CLP | 75.901 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 58.457 | CNH | 405.449 | 508 | 0 | 508 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 5.722 | IDR | 82.594.164 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 395 | PEN | 1.332 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 10/2019 | INR | 3.535.315 | $ | 50.246 | 0 | (270) | (270) | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 7.739 | | 384 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 4.391 | INR | 323.178 | 227 | 0 | 227 | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 32.642 | € | 6.573 | 0 | (163) | (163) | 0,00 |
| | 05/2020 | $ | 105.588 | INR | 7.757.550 | 2.558 | 0 | 2.558 | 0,02 |
| BRC | 07/2019 | AUD | 4.126 | $ | 2.832 | 0 | (64) | (64) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 270.080 | | 41.158 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 2.084.726 | | 2.331.708 | 0 | (42.379) | (42.379) | (0,31) |
| | 07/2019 | £ | 13.441 | | 17.139 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 592 | CLP | 409.546 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.991 | € | 3.549 | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 979 | PEN | 3.272 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 38.639 | SEK | 365.067 | 711 | 0 | 711 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 6.522 | ZAR | 94.850 | 200 | 0 | 200 | 0,00 |
| | 08/2019 | HKD | 163.660 | $ | 20.927 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 15.205.000 | | 139.524 | 0 | (2.105) | (2.105) | (0,02) |
| | 08/2019 | MXN | 853.417 | | 43.539 | 0 | (573) | (573) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 16.805 | HKD | 131.539 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 131.539 | $ | 16.818 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 04/2020 | INR | 7.866.263 | | 108.433 | 0 | (1.319) | (1.319) | (0,01) |
| BSS | 08/2021 | CLP | 4.120.528 | | 6.084 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | ARS | 97.699 | | 2.004 | 0 | (205) | (205) | 0,00 |
| | 07/2019 | AUD | 83.820 | | 58.027 | 0 | (794) | (794) | (0,01) |
| | 07/2019 | CAD | 9.412 | | 7.013 | 0 | (190) | (190) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 26.786 | | 26.862 | 0 | (613) | (613) | (0,01) |
| | 07/2019 | CLP | 418.492 | | 618 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | CNH | 133.630 | | 19.826 | 383 | 0 | 383 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 589.415 | | 89.582 | 4 | (354) | (350) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 200.270 | | 225.804 | 1 | (2.417) | (2.416) | (0,02) |
| | 07/2019 | £ | 637.244 | | 807.412 | 0 | (3.609) | (3.609) | (0,03) |
| | 07/2019 | KRW | 17.024.145 | | 14.613 | 0 | (103) | (103) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 575.625 | | 66.961 | 91 | (645) | (554) | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 51.581 | | 15.650 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 634.404 | | 9.813 | 0 | (227) | (227) | 0,00 |
| | 07/2019 | SEK | 504.253 | | 53.026 | 0 | (1.323) | (1.323) | (0,01) |
| | 07/2019 | SGD | 2 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 29.125 | AUD | 41.834 | 232 | 0 | 232 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 19.344 | CAD | 25.785 | 389 | 0 | 389 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 16.576 | CNH | 113.671 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.606 | COP | 12.204.322 | 194 | 0 | 194 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 43.255 | € | 38.000 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 826.338 | £ | 650.389 | 1.418 | (6) | 1.412 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 32.199 | ¥ | 3.487.444 | 173 | 0 | 173 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 42.964 | SEK | 399.003 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5.226 | TRY | 30.358 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.093 | ZAR | 44.815 | 83 | 0 | 83 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 620.333 | $ | 789.401 | 0 | (1.325) | (1.325) | (0,01) |
| | 08/2019 | MXN | 810.943 | | 40.979 | 0 | (938) | (938 | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 29.944 | HKD | 234.418 | 67 | 0 | 67 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 41.781 | NOK | 355.086 | 0 | (90) | (90) | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 488.552 | $ | 70.418 | 0 | (633) | (633) | (0,01) |
| | 09/2019 | € | 5.347 | TRY | 36.323 | 0 | (57) | (57) | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 60 | $ | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 618 | CLP | 418.492 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 15.603 | PEN | 51.581 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 153.054 | $ | 45.917 | 0 | (418) | (418) | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 17.184 | PEN | 57.774 | 306 | 0 | 306 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 18.548 | TWD | 577.956 | 228 | 0 | 228 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 234.418 | $ | 29.956 | 0 | (80) | (80) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 32.876 | € | 6.622 | 0 | (163) | (163) | 0,00 |
| DUB | 07/2019 | $ | 3.250 | TRY | 18.831 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 9.717 | CNH | 67.331 | 75 | 0 | 75 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 14.777 | IDR | 213.320.772 | 179 | 0 | 179 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 9.536 | TWD | 297.428 | 127 | 0 | 127 | 0,00 |
| FBF | 11/2019 | | 12.851 | | 401.208 | 183 | 0 | 183 | 0,00 |
| | 12/2019 | ZAR | 705.892 | $ | 46.767 | 0 | (2.333) | (2.333) | (0,02) |
| GLM | 07/2019 | CHF | 8.937 | | 9.208 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | 07/2019 | CLP | 20.177.058 | | 29.760 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| | 07/2019 | COP | 2.874.614 | | 902 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 31.425 | | 4.744 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 62.004 | | 70.245 | 0 | (365) | (365) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 23.262 | | 29.522 | 0 | (83) | (83) | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 3.284.075 | | 50.214 | 0 | (1.755) | (1.755) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 18.783 | CLP | 13.061.698 | 462 | 0 | 462 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5.524 | COP | 17.654.704 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | $ | 29.140 | ¥ | 3.190.000 | $ 468 | $ 0 | $ 468 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5.003 | NZD | 7.602 | 103 | 0 | 103 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.539 | PLN | 13.270 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 451.147 | $ | 22.745 | 0 | (575) | (575) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 4.855 | MYR | 20.400 | 80 | 0 | 80 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 55.489 | RUB | 3.653.419 | 1.944 | 0 | 1.944 | 0,01 |
| | 09/2019 | CNH | 55.876 | $ | 8.055 | 0 | (71) | (71) | 0,00 |
| | 09/2019 | TRY | 41 | € | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 29.760 | CLP | 20.177.058 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 48.028 | IDR | 704.812.681 | 1.386 | 0 | 1.386 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 403 | THB | 12.602 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 898 | COP | 2.874.614 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 396 | MXN | 7.739 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 03/2020 | € | 7.663 | RON | 37.277 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 238.709 | $ | 177.082 | 0 | (5.592) | (5.592) | (0,04) |
| | 07/2019 | CNH | 779.227 | | 114.159 | 779 | 0 | 779 | 0,01 |
| | 07/2019 | € | 2.862 | RON | 13.571 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5.125 | $ | 5.830 | 0 | (6 | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 94 | | 120 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | HKD | 582 | | 75 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 31.242 | | 20.664 | 0 | (320) | (320) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.424 | ARS | 169.951 | 419 | 0 | 419 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 13.132 | CAD | 17.680 | 398 | 0 | 398 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 17 | CHF | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 119.313 | CNH | 818.868 | 0 | (165) | (165) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.546 | € | 3.117 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.100 | £ | 862 | 0 | (3 | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 18.340 | HKD | 143.580 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 540.334 | ¥ | 58.149.724 | 5 | (617) | (612) | (0,01) |
| | 07/2019 | | 38.138 | NOK | 332.278 | 835 | 0 | 835 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 31.613 | RUB | 2.095.476 | 1.547 | 0 | 1.547 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 346 | TRY | 2.000 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 57.296.224 | $ | 533.675 | 597 | 0 | 597 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 25.065 | HKD | 196.326 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 78.010 | MXN | 1.538.077 | 1.492 | 0 | 1.492 | 0,01 |
| | 09/2019 | CNH | 659.146 | $ | 94.855 | 0 | (1.006) | (1.006) | (0,01) |
| | 09/2019 | SGD | 80.763 | | 59.104 | 0 | (660) | (660) | (0,01 |
| | 09/2019 | $ | 104.945 | CNH | 722.491 | 310 | (183) | 127 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 24.438 | IDR | 352.981.699 | 309 | 0 | 309 | 0,00 |
| | 10/2019 | INR | 2.564.186 | $ | 34.886 | 0 | (1.754) | (1.754) | (0,01) |
| | 10/2019 | RON | 13.571 | € | 2.836 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 31.832 | $ | 7.459 | 0 | (185) | (185) | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 78.325 | INR | 5.678.000 | 2.808 | 0 | 2.808 | 0,02 |
| | 10/2019 | | 10.071 | PEN | 33.871 | 183 | 0 | 183 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 28.016 | RON | 120.128 | 833 | 0 | 833 | 0,01 |
| | 11/2019 | TWD | 1.553.814 | $ | 49.641 | 0 | (838) | (838) | (0,01) |
| | 12/2019 | HKD | 660.596 | | 84.476 | 0 | (167) | (167) | 0,00 |
| | 04/2020 | $ | 107.199 | INR | 7.866.263 | 2.553 | 0 | 2.553 | 0,02 |
| | 05/2020 | | 989 | | 72.543 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | AUD | 18.833 | $ | 13.063 | 0 | (153) | (153) | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 311.577 | | 15.752 | 0 | (353) | (353) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | CHF | 19.621 | | 19.598 | 0 | (529) | (529) | 0,00 |
| | 07/2019 | CNH | 24.556 | | 3.609 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 995.743 | | 151.216 | 0 | (714) | (714) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 39.036 | RON | 185.088 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 386.153 | $ | 436.120 | 0 | (3.631) | (3.631) | (0,03) |
| | 07/2019 | £ | 40.740 | | 51.280 | 0 | (572) | (572) | 0,00 |
| | 07/2019 | INR | 7.513.572 | | 107.115 | 0 | (1.670) | (1.670) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 73.178.060 | | 671.816 | 0 | (7.396) | (7.396) | (0,05) |
| | 07/2019 | KRW | 25.811.968 | | 22.160 | 0 | (152) | (152) | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 42.725 | | 28.275 | 0 | (422) | (422) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 43.408 | CHF | 42.878 | 574 | 0 | 574 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 7.071 | DKK | 46.635 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 36.318 | £ | 28.821 | 363 | 0 | 363 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 56.170 | INR | 3.911.689 | 465 | 0 | 465 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 31.946 | NOK | 271.660 | 0 | (83) | (83) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 14.449 | PEN | 48.309 | 236 | 0 | 236 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 52.806 | PLN | 197.053 | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.930 | SEK | 27.825 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5.836 | TRY | 33.866 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 6.609 | ZAR | 100.156 | 488 | 0 | 488 | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 181.760 | $ | 9.169 | 0 | (226) | (226) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 88.764 | MXN | 1.765.833 | 2.510 | 0 | 2.510 | 0,02 |
| | 09/2019 | CNH | 150.765 | $ | 21.718 | 0 | (208) | (208) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 9.357 | IDR | 135.004.764 | 108 | 0 | 108 | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 185.088 | € | 38.685 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 51.234 | $ | 1.633 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 11/2019 | $ | 9.761 | TWD | 302.591 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| | 05/2020 | INR | 3.911.689 | $ | 54.284 | 0 | (248) | (248) | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | CNH | 108.797 | | 15.919 | 89 | 0 | 89 | 0,00 |
| | 07/2019 | RON | 70.061 | € | 14.489 | 0 | (331) | (331) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 612 | CLP | 418.492 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 13.683 | TRY | 79.171 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 08/2019 | RUB | 78.142 | $ | 1.199 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09/2019 | $ | 35.205 | RUB | 2.329.564 | $ 1.332 | $ 0 | $ 1.332 | 0,01 |
| | 11/2019 | MYR | 154.978 | $ | 37.085 | 0 | (343) | (343) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 32.929 | € | 6.628 | 0 | (169) | (169) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | AUD | 17.018 | $ | 11.865 | 0 | (78) | (78) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 11.621 | | 11.655 | 0 | (265) | (265) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 73.495 | | 11.178 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 355.823 | | 41.942 | 207 | 0 | 207 | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 28.025 | | 18.291 | 0 | (532) | (532) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 251 | € | 221 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 19 | £ | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 65 | HKD | 507 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 61.313 | ¥ | 6.600.944 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 6.600.944 | $ | 61.459 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 19.296 | HKD | 151.042 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 231 | | 1.808 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 152.850 | $ | 19.535 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 06/2021 | $ | 919 | € | 719 | 0 | (60) | (60) | 0,00 |
| NGF | 07/2019 | CHF | 4.342 | $ | 4.466 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 09/2019 | TRY | 35.032 | € | 5.148 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| RBC | 07/2019 | COP | 17.654.704 | $ | 5.554 | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 73.600 | | 82.536 | 0 | (1.350) | (1.350) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 28.062.000 | | 252.279 | 0 | (8.460) | (8.460) | (0,06) |
| | 07/2019 | $ | 463 | DKK | 3.030 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 523 | HKD | 4.097 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 5.529 | COP | 17.654.704 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 01/2020 | DKK | 3.030 | $ | 470 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | $ | 13.848 | SEK | 130.908 | 262 | 0 | 262 | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 440.626 | $ | 22.278 | 0 | (498) | (498) | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 851 | | 109 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 20.229 | € | 4.237 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 40.213 | RON | 170.913 | 831 | 0 | 831 | 0,01 |
| | 03/2020 | € | 4.169 | | 20.229 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 60.773 | $ | 68.122 | 0 | (1.086) | (1.086) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 1.569.296 | | 14.464 | 0 | (103) | (103) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 191.369 | | 21.869 | 0 | (577) | (577) | 0,00 |
| | 07/2019 | SEK | 253.415 | | 26.782 | 0 | (531) | (531) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 12.439 | £ | 9.849 | 96 | 0 | 96 | 0,00 |
| | 08/2019 | CZK | 21.537 | $ | 941 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 113.050 | | 16.294 | 0 | (147) | (147) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 26.712 | CNH | 184.707 | 150 | 0 | 150 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 338 | IDR | 4.826.978 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 233.166 | $ | 7.450 | 0 | (125) | (125) | 0,00 |
| | 11/2019 | $ | 12.119 | TWD | 377.507 | 145 | 0 | 145) | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | £ | 148 | $ | 186 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | PLN | 35.007 | | 9.299 | 0 | (92) | (92) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 9.070 | RUB | 594.069 | 331 | 0 | 331 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | CHF | 19.067 | $ | 19.126 | 0 | (431) | (431) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 27.025 | | 4.054 | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 6.708 | | 7.520 | 0 | (120) | (120) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 2.902.000 | | 26.184 | 0 | (807) | (807) | (0,01) |
| | 07/2019 | NZD | 12.796 | | 8.475 | 0 | (120) | (120) | 0,00 |
| | 07/2019 | SEK | 439.279 | | 46.741 | 0 | (608) | (608) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 1.513 | AUD | 2.210 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 9.636 | CHF | 9.514 | 123 | 0 | 123 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 16.691 | ¥ | 1.806.489 | 76 | 0 | 76 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 15.519 | NOK | 135.102 | 328 | 0 | 328 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 65.000 | $ | 73.087 | 0 | (1.192) | (1.192) | (0,01) |
| | 08/2019 | HKD | 925.515 | | 118.330 | 0 | (157) | (157) | 0,00 |
| | 08/2019 | MYR | 20.400 | | 5.006 | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 1.808 | | 231 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 05/2020 | INR | 3.918.405 | | 54.506 | 0 | (120) | (120) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | COP | 197.766.542 | | 62.113 | 532 | 0 | 532 | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 228.352 | | 26.507 | 63 | (340) | (277) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 56.128 | COP | 190.232.736 | 3.106 | 0 | 3.106 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 4.770 | £ | 3.744 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 23.230 | SEK | 217.736 | 239 | 0 | 239 | 0,00 |
| | 08/2019 | NZD | 490 | $ | 328 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 61.827 | COP | 197.766.542 | 0 | (550) | (550) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | ¥ | 9.790.000 | $ | 88.341 | 0 | (2.626) | (2.626) | (0,02) |
| | 07/2019 | NOK | 40 | | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 38.458 | | 25.465 | 0 | (366) | (366) | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 174.335 | | 2.699 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 223.968 | | 37.597 | 0 | (1.041) | (1.041) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 52.089 | £ | 41.291 | 465 | 0 | 465 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 11.740 | PLN | 43.842 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 371 | TRY | 2.194 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 27.305.000 | $ | 250.600 | 0 | (3.737) | (3.737) | (0,03) |
| | 09/2019 | CNH | 389.666 | | 56.132 | 0 | (538) | (538) | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 635.965 | | 550 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | MYR | 1.688 | | 406 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 40.320 | | 9.454 | 0 | (229) | (229) | 0,00 |
| | 11/2019 | MYR | 50.000 | | 11.970 | 0 | (105) | (105) | 0,00 |
| | 03/2020 | € | 15.804 | RON | 76.926 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | | | | | | $ 48.642 | $ (146.328) | $ (97.686) | (0,71) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 08/2019 | $ | 24.701 | CAD | 32.465 | $ 162 | $ 0 | $ 162 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 22.980 | | 31.063 | 791 | 0 | 791 | 0,01 |
| | 07/2019 | CAD | 32.465 | $ | 24.683 | 0 | (161) | (161) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | $ | 768 | CAD | 1.035 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| HUS | 08/2019 | | 24.722 | | 32.420 | 106 | 0 | 106 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 23.800 | | 32.083 | 752 | 0 | 752 | 0,01 |
| | 07/2019 | CAD | 32.420 | $ | 24.705 | 0 | (105) | (105) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | $ | 23.719 | CAD | 31.971 | 747 | 0 | 747 | 0,00 |
| | | | | | | $ 2.582 | $ (266) | $ 2.316 | 0,02 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 280.827 | CHF | 281.670 | $ 8.066 | $ 0 | $ 8.066 | 0,06 |
| BPS | 07/2019 | | 29.769 | | 29.679 | 671 | 0 | 671 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF | 303.766 | $ | 310.213 | 0 | (1.341) | (1.341) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 274.986 | CHF | 275.578 | 7.659 | 0 | 7.659 | 0,06 |
| | 08/2019 | | 311.114 | | 303.766 | 1.354 | 0 | 1.354 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | | 302.553 | | 304.222 | 9.469 | 0 | 9.469 | 0,07 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 304.614 | $ | 311.791 | 0 | (634) | (634) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 312.535 | CHF | 304.459 | 646 | 0 | 646 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CHF | 161 | $ | 162 | 0 | (3 | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 7.506 | CHF | 7.465 | 150 | 0 | 150 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 326 | | 322 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | | | $ 28.019 | $ (1.978) | $ 26.041 | 0,19 |

Zum 30. Juni 2019 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 (Currency Exposure) thesaurierend und Class E (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 | 07/2019 | AUD | 12.565 | $ | 8.775 | $ 0 | $ (43) | $ (43) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 24.812 | | 18.864 | 0 | (123) | (123) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 89.598 | | 828 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.685 | CHF | 3.696 | 106 | 0 | 106 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.563.773 | € | 1.399.513 | 29.992 | 0 | 29.992 | 0,22 |
| | 07/2019 | | 685 | £ | 540 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 537 | NOK | 4.680 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 8.784 | AUD | 12.565 | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 18.878 | CAD | 24.812 | 124 | 0 | 124 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.315 | SGD | 1.800 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € | 2.982 | $ | 3.397 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 26.908 | | 34.132 | 0 | (114) | (114) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 56.135 | | 521 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 338 | AUD | 482 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 791 | CAD | 1.066 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 106.677 | € | 94.060 | 458 | (20) | 438 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 331 | HUF | 96.181 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.986 | ¥ | 214.471 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 33.219 | £ | 26.150 | 115 | 0 | 115 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 6.444 | CNY | 44.635 | 53 | 0 | 53 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 7.944 | KRW | 9.418.195 | 210 | 0 | 210 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | | 86.304 | € | 77.163 | 1.569 | 0 | 1.569 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | CAD | 710 | $ | 536 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 1.356.055 | | 1.541.156 | 0 | (3.119) | (3.119) | (0,02) |
| | 07/2019 | ¥ | 226.681 | | 2.121 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 8.365 | AUD | 12.084 | 114 | 0 | 114 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.427.606 | € | 1.277.294 | 26.985 | (8) | 26.977 | 0,19 |
| | 07/2019 | | 117.404 | ¥ | 12.788.052 | 1.290 | 0 | 1.290 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 1.544.336 | € | 1.355.395 | 3.133 | 0 | 3.133 | 0,02 |
| GLM | 07/2019 | € | 12.649 | $ | 14.342 | 0 | (63) | (63) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.571.331 | € | 1.407.991 | 32.090 | 0 | 32.090 | 0,22 |
| | 07/2019 | | 635 | £ | 502 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.800 | IDR | 26.411.243 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 3.696 | $ | 3.783 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 473 | | 604 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 17.729 | CAD | 23.898 | 560 | 0 | 560 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 444 | CZK | 10.277 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 104.039 | € | 93.069 | 1.948 | 0 | 1.948 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 462 | £ | 365 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 3.794 | CHF | 3.696 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09/2019 | $ | 633 | KRW | 750.668 | $ 17 | $ 0 | $ 17 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | | 2.796 | SEK | 26.797 | 93 | 0 | 93 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 1.260 | DKK | 8.295 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 1.907 | MXN | 37.367 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| RBC | 07/2019 | € | 88 | $ | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 15.831 | € | 13.957 | 64 | 0 | 64 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | € | 1.042 | $ | 1.179 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 24.737 | € | 21.869 | 167 | 0 | 167 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 977 | $ | 1.096 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | SEK | 26.797 | | 2.890 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 55.447 | € | 49.349 | 752 | 0 | 752 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 32.314 | £ | 25.530 | 179 | 0 | 179 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 641 | RUB | 42.231 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.896 | SEK | 26.797 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | | 542 | ILS | 1.967 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.245 | PLN | 4.688 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 340 | RUB | 22.470 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 416 | CAD | 558 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 17.804 | € | 15.786 | 174 | 0 | 174 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 565 | £ | 444 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.628 | ¥ | 174.910 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 578 | NZD | 880 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | ¥ | 366.095 | $ | 3.374 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 167.814 | € | 150.074 | 3.090 | 0 | 3.090 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 455 | ¥ | 49.232 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | ¥ | 12.544.291 | $ | 116.547 | 116 | 0 | 116 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 304 | DKK | 2.020 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 116.821 | ¥ | 12.544.291 | 0 | (111) | (111) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.825 | MYR | 7.585 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | | | | | | $ 103.724 | $ (3.676) | $ 100.048 | 0,71 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Investor GBP (Hedged) thesaurierend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 3.759 | £ | 2.979 | $ 32 | $ 0 | $ 32 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 218.796 | $ | 277.500 | 0 | (963) | (963) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 1.790 | £ | 1.409 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 276.247 | | 217.467 | 953 | 0 | 953 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | £ | 216.064 | $ | 274.531 | 0 | (454) | (454) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 269.200 | £ | 212.463 | 1.201 | 0 | 1.201 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 274.775 | | 215.926 | 461 | 0 | 461 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 12.051 | | 9.532 | 80 | 0 | 80 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | £ | 789 | $ | 999 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 136 | £ | 106 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 167 | | 131 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 268.913 | | 212.463 | 1.488 | 0 | 1.488 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | £ | 1.148 | $ | 1.462 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 259.382 | £ | 205.281 | 1.879 | 0 | 1.879 | 0,01 |
| | | | | | | $ 6.099 | $ (1.422) | $ 4.677 | 0,03 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional ILS (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | $ | 1 | ILS | 4 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 40 | | 146 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 42 | | 152 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | | 42 | | 152 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 1 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 4.989 | NOK | 43.445 | $ 106 | $ 0 | $ 106 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | NOK | 1.593 | $ | 186 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 167.535 | NOK | 1.468.856 | 4.742 | 0 | 4.742 | 0,04 |
| BRC | 07/2019 | NOK | 1.320.811 | $ | 155.245 | 330 | 0 | 330 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 153.408 | NOK | 1.303.842 | 0 | (322) | (322) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | NOK | 138.665 | $ | 16.299 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 16.316 | NOK | 138.665 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 9.731 | | 85.457 | 292 | 0 | 292 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | 07/2019 | $ | 180.170 | NOK | 1.575.406 | $ 4.605 | $ 0 | $ 4.605 | 0,03 |
| MYI | 07/2019 | NOK | 1.528.018 | $ | 179.399 | 182 | 0 | 182 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 169.167 | NOK | 1.478.890 | 4.289 | 0 | 4.289 | 0,03 |
| | 08/2019 | | 179.587 | | 1.528.018 | 0 | (181) | (181) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | NOK | 197.028 | $ | 23.141 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 507 | NOK | 4.431 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 7.922 | | 69.072 | 184 | (5) | 179 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 1.018 | | 8.881 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | | | | | | $ 14.835 | $ (544) | $ 14.291 | 0,10 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional NZD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | $ | 2.126 | NZD | 3.266 | $ 68 | $ 0 | $ 68 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 30.723 | | 47.064 | 888 | 0 | 888 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | | 35.120 | | 53.734 | 971 | 0 | 971 | 0,01 |
| IND | 07/2019 | | 7.079 | | 10.695 | 104 | 0 | 104 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 30.853 | | 47.274 | 898 | 0 | 898 | 0,01 |
| RYL | 07/2019 | | 732 | | 1.108 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | NZD | 55.045 | $ | 36.819 | 0 | (152) | (152) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 36.844 | NZD | 55.045 | 153 | 0 | 153 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | NZD | 34 | $ | 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 3.094 | $ (152) | $ 2.942 | 0,02 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Class R SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | $ | 37.978 | SEK | 361.735 | $ 1.009 | $ 0 | $ 1.009 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | | 1.019 | | 9.633 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | | 39.193 | | 375.692 | 1.299 | 0 | 1.299 | 0,01 |
| JPM | 07/2019 | SEK | 379.599 | $ | 40.915 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 41.011 | SEK | 379.599 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SEK | 379.693 | $ | 40.944 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 39.263 | SEK | 375.692 | 1.230 | 0 | 1.230 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 41.039 | | 379.693 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | | | | | | $ 3.580 | $ (21) | $ 3.559 | 0,03 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 145 | SGD | 199 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | SGD | 20.822 | $ | 15.376 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 14.776 | SGD | 20.389 | 296 | 0 | 296 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 15.428 | | 20.883 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 14.781 | | 20.300 | 223 | 0 | 223 | 0,00 |
| DUB | 07/2019 | | 14.772 | | 20.333 | 256 | 0 | 256 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | SGD | 20.895 | $ | 15.432 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 15.477 | SGD | 20.945 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SGD | 20.755 | $ | 15.297 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 38 | SGD | 51 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 15.353 | | 20.821 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 14.241 | | 19.622 | 262 | 0 | 262 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SGD | 19.909 | $ | 14.720 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 622 | SGD | 852 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 14.765 | | 19.960 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 458 | | 633 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.135 | $ (73) | $ 1.062 | 0,01 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 44.018** | **0,31** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Freddie Mac, TBA** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.07.2049 | $ 1.200 | $ (1.255) | (0,01) |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 1.500 | (1.550) | (0,01) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (2.805)** | **(0,02)** |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Lloyds Bank Corporate Markets PLC** | | | |
| 2,843 % fällig am 24.09.2020 | $ 28.300 | $ 28.385 | 0,20 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 28.385** | **0,20** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 17.948.009** | **128,82** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (4.015.738)** | **(28,82)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 13.932.271** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(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 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 401.247 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 434 und Barmittel in Höhe von USD 2.410 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 164.968 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 73.570 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Kredit-zins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 6.918 | U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2021 | $ (7.059) | $ 6.918 | $ 6.919 | 0,05 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (7.059)** | **$ 6.918** | **$ 6.919** | **0,05** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert** (1)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.041.293 | $ 16.820.134 | $ 22.917 | $ 17.884.344 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 28.385 | 0 | 28.385 |
| Finanzderivate[3] | 22.825 | 15.260 | 0 | 38.085 |
| Leerverkäufe | 0 | (2.805) | 0 | (2.805) |
| **Summen** | **$ 1.064.118** | **$ 16.860.974** | **$ 22.917** | **$ 17.948.009** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 545.341 | $ 13.620.787 | $ 5.958 | $ 14.172.086 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 28.307 | 0 | 28.307 |
| Finanzderivate[3] | (8.324) | (11.564) | 0 | (19.888) |
| Leerverkäufe | 0 | (2.752) | 0 | (2.752) |
| **Summen** | **$ 537.017** | **$ 13.634.778** | **$ 5.958** | **$ 14.177.753** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Verbindlich-keiten aus Pensions-geschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| CFR | (0,800)% | 08.05.2019 | TBD[1] | € (5.050) | $ (5.744) | (0,04) |
| | 1,750 | 18.06.2019 | TBD[1] | $ (1.813) | (1.814) | (0,02) |
| IND | (0,430) | 24.06.2019 | 25.07.2019 | € (91.637) | (104.348) | (0,75) |
| | 2,570 | 21.06.2019 | 16.07.2019 | $ (16.894) | (16.906) | (0,12) |
| | 2,600 | 25.06.2019 | 25.07.2019 | (30.918) | (30.931) | (0,22) |
| SCX | 2,680 | 24.06.2019 | 22.07.2019 | (127.863) | (127.929) | (0,92) |
| | 2,680 | 27.06.2019 | 22.07.2019 | (8.667) | (8.672) | (0,06) |
| | 2,710 | 14.06.2019 | 05.07.2019 | (98.947) | (99.074) | (0,71) |
| SGY | 2,540 | 13.06.2019 | 05.07.2019 | (1.110) | (1.112) | (0,01) |
| TDM | 2,050 | 24.04.2019 | TBD[1] | (4.001) | (4.017) | (0,03) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (400.547)** | **(2,88)** |

**(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.**

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 28.207 | $ (27.790) | $ 417 |
| BPS | 5.094 | (5.050) | 44 |
| BRC | (48.674) | 43.150 | (5.524) |
| BSH | 0 | (30) | (30) |
| BSS | 24 | 0 | 24 |
| CBK | 27.700 | (27.930) | (230) |
| DUB | 626 | (1.160) | (534) |
| FBF | (2.154) | 1.930 | (224) |
| GLM | 44.330 | (41.830) | 2.500 |
| GST | (3.020) | 3.030 | 10 |
| HUS | 4.318 | (800) | 3.518 |
| IND | 990 | (1.250) | (260) |
| JPM | (8.328) | 5.530 | (2.798) |
| MSB | 525 | 0 | 525 |
| MYC | (1.342) | (7.270) | (8.612) |
| MYI | 4.561 | (5.330) | (769) |
| NGF | 57 | 320 | 377 |
| RBC | (9.746) | 9.590 | (156) |
| RYL | 811 | (1.687) | (876) |
| SAL | (44) | 60 | 16 |
| SCX | 2.004 | (850) | 1.154 |
| SOG | 271 | (400) | (129) |
| SSB | (141) | 670 | 529 |
| TOR | 6.112 | (6.280) | (168) |
| UAG | (8.163) | 8.000 | (163) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 103,03 | 71,63 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 25,29 | 58,28 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,05 | 0,11 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,17 | (0,08) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,21) | 0,04 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,31) | (0,14) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,02) | (0,03) |
| Einlagenzertifikate | 0,20 | 0,26 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (2,88) | (4,97) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,12 | 0,16 |
| Australien | 0,51 | 0,54 |
| Belgien | 0,17 | 0,17 |
| Brasilien | 0,51 | 0,58 |
| Kanada | 2,89 | 4,32 |
| Cayman-Inseln | 2,94 | 4,18 |
| China | 2,23 | 0,00 |
| Dänemark | 3,69 | 2,79 |
| Finnland | 0,06 | 0,06 |
| Frankreich | 2,34 | 2,90 |
| Deutschland | 3,75 | 2,48 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Guernsey, Kanalinseln | 0,10 | 0,12 |
| Hongkong | 0,52 | 0,28 |
| Indien | 0,12 | 0,09 |
| Indonesien | 0,07 | 0,09 |
| Irland | 8,53 | 5,84 |
| Israel | 0,12 | 0,15 |
| Italien | 3,31 | 1,83 |
| Japan | 9,28 | 6,33 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,09 | 0,10 |
| Kasachstan | 0,01 | 0,01 |
| Kuwait | 0,46 | 0,55 |
| Litauen | 0,15 | 0,18 |
| Luxemburg | 1,45 | 2,08 |
| Malaysia | 0,35 | 0,00 |
| Mexiko | 0,05 | 0,05 |
| Marokko | 0,08 | 0,10 |
| Multinational | 0,17 | 0,22 |
| Niederlande | 1,95 | 1,92 |
| Neuseeland | 0,25 | 0,30 |
| Norwegen | 0,45 | 0,52 |
| Peru | 0,60 | 0,00 |
| Polen | 0,07 | 0,08 |
| Portugal | 0,02 | 0,03 |
| Katar | 1,19 | 0,38 |
| Rumänien | 0,01 | 0,01 |
| Russland | 0,78 | 0,00 |
| Saudi-Arabien | 1,62 | 1,95 |
| Singapur | 0,28 | 0,30 |
| Slowenien | 0,44 | 1,13 |
| Südkorea | 0,60 | 0,04 |
| Spanien | 3,90 | 2,14 |
| Supranational | 0,37 | 0,14 |
| Schweden | 3,25 | 4,89 |
| Schweiz | 0,75 | 1,02 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,51 | 0,48 |
| Großbritannien | 9,11 | 10,90 |
| Vereinigte Staaten | 49,91 | 54,38 |
| Kurzfristige Instrumente | 7,88 | 12,73 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,36 | 0,48 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,18 | (0,08) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | 0,00 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | 0,04 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,05 | (0,01) |
| Zinsswaps — Basisswaps | 0,01 | 0,01 |
| Zinsswaps | (0,27) | 0,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | 0,00 | 0,02 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,01) |
| Devisenoptionen | (0,01) | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | (0,05) | (0,07) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | (0,02) |
| Cross-Currency Swaps | 0,00 | 0,07 |
| Zinsswaps | 0,03 | (0,03) |
| Total Return Swaps auf Indizes | (0,05) | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | (0,71) | (0,18) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,11 | 0,10 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,02) | (0,03) |
| Einlagenzertifikate | 0,20 | 0,26 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (28,82) | (30,07) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | $ | 1.300 | $ 1.341 | 0,20 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 600 | 615 | 0,09 |
| 4,625 % fällig am 01.07.2022 | | 1.300 | 1.358 | 0,20 |
| **American Express Credit Corp.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 26.05.2020 | | 1.000 | 1.001 | 0,15 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.02.2021 | | 800 | 810 | 0,12 |
| **Annington Funding PLC** | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.07.2024 | € | 1.800 | 2.103 | 0,31 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 800 | 866 | 0,13 |
| **Asian Development Bank** | | | | |
| 1,875 % fällig am 10.08.2022 | | 1.000 | 1.002 | 0,15 |
| **Australia & New Zealand Banking Group Ltd.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 17.05.2021 | | 900 | 917 | 0,14 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.08.2025 | | 1.100 | 1.146 | 0,17 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h) | € | 200 | 236 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (f)(h) | | 1.000 | 1.199 | 0,18 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (f)(h) | | 400 | 469 | 0,07 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 3,848 % fällig am 12.04.2023 | $ | 200 | 208 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 19.03.2025 (f)(h) | € | 1.400 | 1.511 | 0,22 |
| **Bank of China Ltd.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 12.07.2021 | | 300 | 346 | 0,05 |
| **Bank of Montreal** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.06.2021 | $ | 500 | 498 | 0,07 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | |
| 1,875 % fällig am 26.04.2021 | | 350 | 349 | 0,05 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | | 2.800 | 3.059 | 0,45 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 0,625 % fällig am 14.11.2023 | € | 1.400 | 1.583 | 0,23 |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | £ | 400 | 510 | 0,08 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | | 100 | 131 | 0,02 |
| 3,650 % fällig am 16.03.2025 | $ | 1.000 | 1.007 | 0,15 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | € | 200 | 231 | 0,03 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | £ | 600 | 771 | 0,11 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (f)(h) | | 900 | 1.198 | 0,18 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (f)(h) | $ | 800 | 821 | 0,12 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (f)(h) | € | 400 | 494 | 0,07 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (f)(h) | $ | 400 | 420 | 0,06 |
| **BNG Bank NV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 14.12.2020 | | 2.000 | 2.005 | 0,30 |
| 4,375 % fällig am 16.02.2021 | | 350 | 364 | 0,05 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 3.300 | 3.543 | 0,52 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 200 | 200 | 0,03 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | € | 400 | 476 | 0,07 |
| **Caja Rural de Navarra SCC** | | | | |
| 0,875 % fällig am 08.05.2025 | | 2.000 | 2.384 | 0,35 |
| **Castellum AB** | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | | 800 | 965 | 0,14 |
| **Chubb INA Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 15.06.2027 | | 1.900 | 2.193 | 0,32 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 29.01.2022 | | 2.300 | 2.658 | 0,39 |
| 4,500 % fällig am 14.01.2022 | $ | 1.100 | 1.157 | 0,17 |
| **Citizens Bank N.A.** | | | | |
| 3,091 % fällig am 26.05.2020 | | 1.100 | 1.103 | 0,16 |
| **Compass Bank** | | | | |
| 3,500 % fällig am 11.06.2021 | | 900 | 917 | 0,14 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,193 % fällig am 26.09.2023 | | 900 | 901 | 0,13 |
| 3,875 % fällig am 26.09.2023 | | 1.300 | 1.372 | 0,20 |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (f)(h) | € | 800 | 950 | 0,14 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 (h) | | 900 | 1.076 | 0,16 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | $ | 1.600 | $ 1.765 | 0,26 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 1,000 % fällig am 24.06.2027 | € | 1.000 | 1.155 | 0,17 |
| 3,574 % fällig am 09.01.2023 | $ | 1.300 | 1.328 | 0,20 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 250 | 261 | 0,04 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | | 1.500 | 1.633 | 0,24 |
| **Danske Hypotek AB** | | | | |
| 1,000 % fällig am 21.12.2022 | SEK | 30.000 | 3.341 | 0,49 |
| 1,000 % fällig am 20.12.2023 | | 10.000 | 1.118 | 0,17 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 800 | 919 | 0,14 |
| 4,250 % fällig am 04.02.2021 | $ | 2.800 | 2.826 | 0,42 |
| **Deutsche Pfandbriefbank AG** | | | | |
| 2,250 % fällig am 04.05.2020 | | 400 | 400 | 0,06 |
| 2,500 % fällig am 31.05.2022 | | 2.600 | 2.632 | 0,39 |
| 3,375 % fällig am 22.11.2021 | | 4.800 | 4.936 | 0,73 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 17.01.2025 | € | 1.100 | 1.298 | 0,19 |
| 1,875 % fällig am 15.09.2021 | $ | 1.700 | 1.696 | 0,25 |
| 2,250 % fällig am 18.02.2020 | | 250 | 250 | 0,04 |
| 2,375 % fällig am 20.09.2022 | | 1.500 | 1.516 | 0,22 |
| 2,500 % fällig am 25.01.2021 | | 1.100 | 1.108 | 0,16 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | € | 1.100 | 1.368 | 0,20 |
| **DNB Boligkreditt A/S** | | | | |
| 0,625 % fällig am 19.06.2025 | | 1.600 | 1.904 | 0,28 |
| **ERP Operating LP** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2029 | $ | 900 | 912 | 0,13 |
| 4,150 % fällig am 01.12.2028 | | 1.300 | 1.439 | 0,21 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | |
| 0,200 % fällig am 17.01.2024 | € | 1.300 | 1.522 | 0,23 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.01.2029 | | 500 | 605 | 0,09 |
| 2,375 % fällig am 24.05.2027 | $ | 1.700 | 1.751 | 0,26 |
| 2,700 % fällig am 12.01.2023 | AUD | 3.600 | 2.647 | 0,39 |
| 2,875 % fällig am 13.06.2025 | $ | 1.560 | 1.646 | 0,24 |
| 3,300 % fällig am 03.02.2028 | AUD | 1.000 | 784 | 0,12 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,100 % fällig am 07.12.2022 | € | 200 | 219 | 0,03 |
| 3,200 % fällig am 15.01.2021 | $ | 1.100 | 1.104 | 0,16 |
| 3,273 % fällig am 24.09.2020 | | 1.800 | 1.799 | 0,27 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | | 1.700 | 1.692 | 0,25 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 04.11.2020 | £ | 1.000 | 1.345 | 0,20 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 08.07.2022 | $ | 400 | 407 | 0,06 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 4,223 % fällig am 01.05.2029 | | 2.100 | 2.254 | 0,33 |
| **HSBC Bank Canada** | | | | |
| 3,300 % fällig am 28.11.2021 | | 1.000 | 1.030 | 0,15 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.12.2024 | € | 3.200 | 3.835 | 0,57 |
| 3,033 % fällig am 22.11.2023 | $ | 2.000 | 2.026 | 0,30 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | | 1.050 | 1.071 | 0,16 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 3,320 % fällig am 02.10.2023 | | 2.200 | 2.199 | 0,32 |
| 4,100 % fällig am 02.10.2023 | | 1.100 | 1.163 | 0,17 |
| 4,550 % fällig am 02.10.2028 | | 1.200 | 1.322 | 0,20 |
| **International Bank for Reconstruction & Development** | | | | |
| 2,250 % fällig am 17.01.2023 | CAD | 3.700 | 2.888 | 0,43 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.09.2022 (b) | $ | 1.700 | 1.702 | 0,25 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 01.04.2026 | | 500 | 517 | 0,08 |
| 3,797 % fällig am 23.07.2024 | | 3.500 | 3.673 | 0,54 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 20.600 | 3.207 | 0,47 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 9.597 | 1.513 | 0,22 |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 0,875 % fällig am 27.06.2023 | € | 400 | 469 | 0,07 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.12.2024 | $ | 1.100 | 1.133 | 0,17 |
| 4,750 % fällig am 15.12.2028 | | 1.100 | 1.223 | 0,18 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2029 (h) | $ | 1.300 | $ 1.400 | 0,21 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.04.2024 (c) | € | 2.700 | 3.141 | 0,46 |
| 0,000 % fällig am 04.07.2024 (c) | | 2.000 | 2.325 | 0,34 |
| 0,750 % fällig am 15.01.2029 | | 1.200 | 1.471 | 0,22 |
| 2,000 % fällig am 29.09.2022 | $ | 3.400 | 3.424 | 0,51 |
| **Landesbank Baden-Wuerttemberg** | | | | |
| 2,375 % fällig am 31.05.2022 | | 5.700 | 5.762 | 0,85 |
| **Landshypotek Bank AB** | | | | |
| 0,700 % fällig am 09.05.2022 | SEK | 16.000 | 1.756 | 0,26 |
| **Lansforsakringar Hypotek AB** | | | | |
| 1,250 % fällig am 20.09.2023 | | 4.400 | 497 | 0,07 |
| 2,250 % fällig am 21.09.2022 | | 20.300 | 2.347 | 0,35 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 1,375 % fällig am 07.03.2024 | € | 1.350 | 1.584 | 0,23 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | £ | 1.100 | 1.745 | 0,26 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,100 % fällig am 06.07.2021 | $ | 900 | 911 | 0,13 |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (f)(h) | £ | 200 | 278 | 0,04 |
| **Marsh & McLennan Cos., Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 10.03.2025 | $ | 500 | 520 | 0,08 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,980 % fällig am 09.10.2023 | € | 1.800 | 2.112 | 0,31 |
| 2,527 % fällig am 13.09.2023 | $ | 5.200 | 5.193 | 0,77 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,956 % fällig am 16.10.2024 | € | 1.600 | 1.882 | 0,28 |
| 3,451 % fällig am 11.09.2024 | $ | 200 | 202 | 0,03 |
| 3,922 % fällig am 11.09.2024 | | 400 | 419 | 0,06 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 3,249 % fällig am 10.06.2022 | | 1.500 | 1.502 | 0,22 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 21.10.2021 | AUD | 200 | 145 | 0,02 |
| **National Westminster Bank PLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 13.01.2024 | £ | 400 | 598 | 0,09 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | $ | 1.500 | 1.532 | 0,23 |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | | 1.100 | 1.149 | 0,17 |
| **Nederlandse Waterschapsbank NV** | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.03.2026 | | 1.000 | 1.020 | 0,15 |
| **New York Life Global Funding** | | | | |
| 2,350 % fällig am 14.07.2026 | | 550 | 541 | 0,08 |
| **NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank** | | | | |
| 2,875 % fällig am 16.02.2021 | | 800 | 809 | 0,12 |
| **Nordea Hypotek AB** | | | | |
| 1,000 % fällig am 08.04.2022 | SEK | 6.300 | 699 | 0,10 |
| 1,250 % fällig am 20.09.2023 | | 9.700 | 1.096 | 0,16 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 7.400 | 1.147 | 0,17 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 13.711 | 2.160 | 0,32 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 56 | 9 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 0,156 % fällig am 01.10.2022 | € | 1.300 | 1.499 | 0,22 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 34.900 | 5.426 | 0,80 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 12.555 | 1.981 | 0,29 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 11.675 | 1.840 | 0,27 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 72 | 11 | 0,00 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.03.2028 | € | 2.300 | 2.806 | 0,41 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 10.858 | 1.711 | 0,25 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 8.831 | 1.389 | 0,21 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 2,300 % fällig am 22.03.2021 | $ | 350 | 352 | 0,05 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 08.03.2023 | € | 100 | 118 | 0,02 |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | | 200 | 242 | 0,04 |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | $ | 500 | 513 | 0,08 |
| 3,988 % fällig am 15.05.2023 | | 500 | 499 | 0,07 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 1.100 | 1.194 | 0,18 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (f)(h) | | 600 | 616 | 0,09 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (f)(h) | | 300 | 324 | 0,05 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 0,468 % fällig am 18.05.2023 | € | 600 | 675 | 0,10 |
| 2,875 % fällig am 05.08.2021 | $ | 600 | 601 | 0,09 |
| 3,571 % fällig am 10.01.2023 | | 1.300 | 1.323 | 0,20 |
| 3,625 % fällig am 14.01.2026 | £ | 300 | 409 | 0,06 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Skandinaviska Enskilda Banken AB** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.12.2021 | SEK | 11.000 | $ 1.232 | 0,18 |
| **Stadshypotek AB** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.12.2021 | | 8.000 | 896 | 0,13 |
| 4,500 % fällig am 21.09.2022 | | 25.000 | 3.086 | 0,46 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,550 % fällig am 06.11.2023 | € | 1.400 | 1.639 | 0,24 |
| 2,440 % fällig am 18.06.2024 | $ | 1.000 | 1.010 | 0,15 |
| 2,450 % fällig am 20.10.2020 | | 2.250 | 2.253 | 0,33 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,934 % fällig am 09.03.2021 | | 1.400 | 1.413 | 0,21 |
| **Sveriges Sakerstallda Obligationer AB** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.06.2022 | SEK | 12.000 | 1.343 | 0,20 |
| **Swedbank Hypotek AB** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.09.2021 | | 8.000 | 883 | 0,13 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | £ | 384 | 625 | 0,09 |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | | 295 | 485 | 0,07 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 195 | 329 | 0,05 |
| **UBS AG** | | | | |
| 2,200 % fällig am 08.06.2020 | $ | 600 | 600 | 0,09 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h) | | 700 | 744 | 0,11 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | | 2.200 | 2.469 | 0,36 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h) | € | 400 | 482 | 0,07 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.05.2027 | | 1.350 | 1.608 | 0,24 |
| **Visa, Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 14.12.2025 | $ | 550 | 577 | 0,09 |
| **WEA Finance LLC** | | | | |
| 2,700 % fällig am 17.09.2019 | | 700 | 700 | 0,10 |
| | | | 224.294 | 33,11 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.09.2021 | | 500 | 499 | 0,07 |
| **Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.04.2038 | | 300 | 317 | 0,05 |
| **Ascension Health** | | | | |
| 3,945 % fällig am 15.11.2046 | | 500 | 542 | 0,08 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.03.2021 | | 2.500 | 2.533 | 0,37 |
| 3,650 % fällig am 15.03.2023 | | 200 | 206 | 0,03 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 2,091 % fällig am 14.09.2021 | | 1.400 | 1.387 | 0,20 |
| 2,567 % fällig am 02.11.2021 | | 1.000 | 1.004 | 0,15 |
| 2,849 % fällig am 03.03.2022 | | 500 | 506 | 0,07 |
| 2,978 % fällig am 15.02.2022 | | 1.600 | 1.596 | 0,24 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 (b) | | 1.000 | 1.025 | 0,15 |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.10.2025 | | 600 | 648 | 0,10 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | |
| 3,342 % fällig am 22.10.2020 | | 600 | 600 | 0,09 |
| 3,800 % fällig am 22.10.2021 | | 1.300 | 1.337 | 0,20 |
| 4,300 % fällig am 01.05.2024 | | 600 | 637 | 0,09 |
| 4,600 % fällig am 01.11.2025 | | 500 | 545 | 0,08 |
| **CRH America Finance, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 09.05.2027 | | 400 | 399 | 0,06 |
| 3,950 % fällig am 04.04.2028 | | 2.000 | 2.046 | 0,30 |
| 4,400 % fällig am 09.05.2047 | | 300 | 286 | 0,04 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 09.03.2021 | | 100 | 101 | 0,01 |
| 3,700 % fällig am 09.03.2023 | | 300 | 310 | 0,05 |
| 4,100 % fällig am 25.03.2025 | | 3.100 | 3.272 | 0,48 |
| 4,300 % fällig am 25.03.2028 | | 300 | 317 | 0,05 |
| 5,050 % fällig am 25.03.2048 | | 100 | 107 | 0,02 |
| **Danone S.A.** | | | | |
| 2,947 % fällig am 02.11.2026 | | 1.000 | 999 | 0,15 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 1.000 | 1.031 | 0,15 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 09.03.2022 | | 1.400 | 1.450 | 0,21 |
| **Frontier Finance PLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 23.03.2022 | £ | 1.000 | 1.330 | 0,20 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 07.01.2021 | $ | 300 | $ 309 | 0,05 |
| 4,650 % fällig am 17.10.2021 | | 700 | 730 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 07.06.2021 | £ | 1.000 | 1.366 | 0,20 |
| **General Mills, Inc.** | | | | |
| 3,141 % fällig am 16.04.2021 | $ | 100 | 100 | 0,01 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2023 | | 1.400 | 1.491 | 0,22 |
| **Humana, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 01.10.2024 | | 250 | 262 | 0,04 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 3,115 % fällig am 10.02.2021 | | 1.600 | 1.597 | 0,24 |
| 3,950 % fällig am 15.07.2025 | | 600 | 625 | 0,09 |
| **Macquarie University** | | | | |
| 3,500 % fällig am 07.09.2028 | AUD | 800 | 623 | 0,09 |
| **Masco Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2021 | $ | 600 | 609 | 0,09 |
| **Medtronic Global Holdings S.C.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 02.12.2022 (b)(c) | € | 1.500 | 1.711 | 0,25 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.12.2030 | $ | 496 | 463 | 0,07 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.10.2021 | | 1.000 | 991 | 0,15 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 21.07.2021 | | 400 | 397 | 0,06 |
| 2,860 % fällig am 29.06.2020 | | 300 | 301 | 0,04 |
| **President & Fellows of Harvard College** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.01.2039 | | 450 | 662 | 0,10 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.06.2022 | | 300 | 300 | 0,04 |
| 2,903 % fällig am 24.06.2022 | | 300 | 299 | 0,04 |
| **RELX Capital, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.10.2022 | | 350 | 356 | 0,05 |
| **Ryder System, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.06.2022 | | 2.800 | 2.833 | 0,42 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 2.300 | 2.390 | 0,35 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | | 1.929 | 2.006 | 0,30 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | | |
| 5,462 % fällig am 16.02.2021 | | 1.200 | 1.258 | 0,19 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | £ | 1.100 | 1.447 | 0,21 |
| **Zoetis, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 20.08.2021 | $ | 500 | 508 | 0,08 |
| 3,900 % fällig am 20.08.2028 | | 500 | 533 | 0,08 |
| | | | 49.197 | 7,26 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **American Transmission Systems, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2022 | | 700 | 746 | 0,11 |
| **American Water Capital Corp.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 01.06.2029 | | 2.500 | 2.602 | 0,38 |
| **Anglian Water Services Financing PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 10.08.2025 | £ | 800 | 1.016 | 0,15 |
| 2,750 % fällig am 26.10.2029 | | 1.300 | 1.776 | 0,26 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.03.2023 | € | 1.000 | 1.236 | 0,18 |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | $ | 1.400 | 1.407 | 0,21 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 1.500 | 1.514 | 0,22 |
| 3,616 % fällig am 12.06.2024 | | 2.200 | 2.229 | 0,33 |
| **Avangrid, Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 01.12.2024 | | 2.000 | 2.041 | 0,30 |
| 3,800 % fällig am 01.06.2029 | | 600 | 628 | 0,09 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 9,625 % fällig am 15.12.2030 | | 700 | 1.056 | 0,16 |
| **ESB Finance DAC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 11.06.2030 | € | 900 | 1.058 | 0,16 |
| **Iberdrola Finance Ireland DAC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 11.09.2019 | $ | 900 | 904 | 0,13 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 30.06.2021 | | 800 | 802 | 0,12 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.06.2047 | | 300 | 289 | 0,04 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 3,097 % fällig am 15.01.2021 | | 1.500 | 1.496 | 0,22 |
| **Southern Power Co.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.12.2021 | $ | 600 | $ 601 | 0,09 |
| **Telstra Corp. Ltd.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 12.10.2021 | | 500 | 526 | 0,08 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 08.02.2029 | | 1.800 | 1.932 | 0,29 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 24.11.2026 | € | 3.000 | 3.500 | 0,52 |
| | | | 27.359 | 4,04 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 300.850 | 44,41 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Chicago Transit Authority, Illinois Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 6,200 % fällig am 01.12.2040 | $ | 100 | 131 | 0,02 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, Series 2003** | | | | |
| 5,100 % fällig am 01.06.2033 | | 100 | 105 | 0,01 |
| **Texas Public Finance Authority Revenue Notes, Series 2014** | | | | |
| 8,250 % fällig am 01.07.2024 | | 1.065 | 1.070 | 0,16 |
| | | | 1.306 | 0,19 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae UMBS** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2047 | | 10.342 | 10.743 | 1,58 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 91.900 | 93.944 | 13,87 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | | 41.500 | 42.882 | 6,33 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.05.2048 | | 16.177 | 16.704 | 2,46 |
| 4,000 % fällig am 01.06.2048 | | 16.407 | 17.123 | 2,53 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 3,629 % fällig am 20.04.2067 | | 373 | 380 | 0,06 |
| | | | 181.776 | 26,83 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 (j) | | 3.309 | 3.284 | 0,49 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (i)(j) | | 8.091 | 8.103 | 1,20 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 (j) | | 7.354 | 7.477 | 1,10 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | | 108 | 110 | 0,02 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 (j) | | 3.108 | 3.273 | 0,48 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | | 767 | 872 | 0,13 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 (j) | | 3.511 | 4.225 | 0,62 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | | 622 | 833 | 0,12 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.06.2021 | | 200 | 203 | 0,03 |
| 2,875 % fällig am 30.04.2025 (i) | | 8.500 | 8.998 | 1,33 |
| | | | 37.378 | 5,52 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.10.2046 | | 1.724 | 1.218 | 0,18 |
| 3,444 % fällig am 25.10.2046 | | 125 | 112 | 0,02 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 4,185 % fällig am 25.09.2035 | | 247 | 165 | 0,02 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 28.02.2037 | | 303 | 290 | 0,04 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 3,987 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 901 | 756 | 0,11 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 3,799 % fällig am 25.07.2037 | | 15 | 14 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 4,639 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 709 | 613 | 0,09 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.06.2036 | | 155 | 147 | 0,02 |
| 2,524 % fällig am 25.11.2036 | | 449 | 437 | 0,06 |
| 2,614 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 815 | 751 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2034 | | 411 | 441 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036 | | 1.378 | 960 | 0,14 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.04.2046 | | 2.283 | 1.041 | 0,15 |
| 2,984 % fällig am 25.03.2035 ^ | | 709 | 614 | 0,09 |
| 3,084 % fällig am 25.03.2035 ^ | | 136 | 129 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 519 | 438 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | $ | 1.031 | $ 807 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 | | 1.049 | 901 | 0,13 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2047 | | 121 | 100 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 172 | 156 | 0,02 |
| **EMF-UK PLC** | | | | |
| 1,769 % fällig am 13.03.2046 | £ | 364 | 461 | 0,07 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 0,936 % fällig am 15.06.2044 | | 55 | 68 | 0,01 |
| **EuroMASTR PLC** | | | | |
| 0,986 % fällig am 15.06.2040 | | 68 | 84 | 0,01 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | € | 432 | 486 | 0,07 |
| 0,946 % fällig am 15.12.2044 | £ | 86 | 109 | 0,02 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,443 % fällig am 12.09.2065 | | 642 | 817 | 0,12 |
| 1,473 % fällig am 12.09.2065 | | 256 | 326 | 0,05 |
| 1,488 % fällig am 12.03.2059 | | 795 | 1.012 | 0,15 |
| 1,743 % fällig am 12.09.2068 | | 1.741 | 2.223 | 0,33 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | $ | 50 | 34 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,716 % fällig am 25.11.2035 | | 265 | 268 | 0,04 |
| 4,789 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 183 | 175 | 0,03 |
| **Harben Finance PLC** | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | £ | 390 | 496 | 0,07 |
| **Holmes Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,101 % fällig am 15.10.2054 | | 286 | 363 | 0,05 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.01.2037 | $ | 946 | 811 | 0,12 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,290 % fällig am 25.12.2034 | | 244 | 245 | 0,04 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.10.2036 | | 471 | 462 | 0,07 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 4,473 % fällig am 25.08.2035 | | 367 | 386 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 | | 1.112 | 854 | 0,13 |
| **Kensington Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 2,598 % fällig am 14.06.2040 | | 219 | 215 | 0,03 |
| **Lanark Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,619 % fällig am 22.12.2069 | £ | 1.000 | 1.277 | 0,19 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 3,254 % fällig am 25.03.2047 | $ | 826 | 813 | 0,12 |
| **Liberty Funding Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,220 % fällig am 10.06.2051 | AUD | 1.600 | 1.123 | 0,17 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | |
| 1,001 % fällig am 01.01.2061 | £ | 62 | 74 | 0,01 |
| **Mulcair Securities DAC** | | | | |
| 0,695 % fällig am 24.04.2071 | € | 1.800 | 2.054 | 0,30 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,061 % fällig am 15.01.2039 | £ | 624 | 754 | 0,11 |
| 1,760 % fällig am 15.05.2045 (b) | | 1.200 | 1.528 | 0,23 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,511 % fällig am 16.09.2059 | AUD | 396 | 277 | 0,04 |
| **Real Estate Asset Liquidity Trust** | | | | |
| 3,072 % fällig am 12.08.2053 | CAD | 359 | 280 | 0,04 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.06.2037 ^ | $ | 600 | 529 | 0,08 |
| 3,752 % fällig am 25.11.2037 | | 464 | 431 | 0,06 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,582 % fällig am 20.03.2050 | £ | 878 | 1.116 | 0,16 |
| 1,732 % fällig am 20.12.2046 | | 872 | 1.112 | 0,16 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | | 938 | 1.192 | 0,18 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,493 % fällig am 12.06.2046 | | 1.293 | 1.630 | 0,24 |
| 1,763 % fällig am 12.06.2046 | | 735 | 934 | 0,14 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 0,963 % fällig am 12.06.2044 | | 55 | 66 | 0,01 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 4,044 % fällig am 20.07.2037 | $ | 470 | 445 | 0,07 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 2,684 % fällig am 25.01.2036 | | 197 | 183 | 0,03 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,694 % fällig am 25.10.2036 | | 425 | 377 | 0,06 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 5,965 % fällig am 25.07.2037 | $ | 3.289 | $ 1.775 | 0,26 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 1.900 | 2.427 | 0,36 |
| **Trinidad Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,622 % fällig am 24.01.2059 | | 1.072 | 1.355 | 0,20 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,781 % fällig am 12.12.2052 | | 1.300 | 1.653 | 0,24 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 1,174 % fällig am 10.10.2040 | | 390 | 459 | 0,07 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 3,504 % fällig am 25.02.2046 | $ | 573 | 586 | 0,09 |
| 3,993 % fällig am 25.10.2035 | | 201 | 201 | 0,03 |
| 3,998 % fällig am 25.09.2036 | | 121 | 118 | 0,02 |
| 4,347 % fällig am 25.09.2033 | | 105 | 110 | 0,02 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 2,275 % fällig am 21.09.2049 | £ | 593 | 760 | 0,11 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.04.2035 | $ | 616 | 503 | 0,07 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 4,813 % fällig am 25.03.2036 | | 330 | 340 | 0,05 |
| 4,843 % fällig am 25.06.2035 | | 106 | 109 | 0,02 |
| 4,991 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 378 | 379 | 0,06 |
| | | | 46.955 | 6,93 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Accunia European CLO BV** | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 500 | 570 | 0,08 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,304 % fällig am 25.12.2034 | $ | 158 | 157 | 0,02 |
| 3,304 % fällig am 25.08.2035 | | 1.600 | 1.592 | 0,23 |
| **Arbour CLO DAC** | | | | |
| 0,580 % fällig am 15.03.2029 | € | 900 | 1.022 | 0,15 |
| **Avoca CLO DAC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.01.2030 | | 700 | 798 | 0,12 |
| **B&M CLO Ltd.** | | | | |
| 3,331 % fällig am 16.04.2026 | $ | 878 | 878 | 0,13 |
| **Babson Euro CLO BV** | | | | |
| 0,509 % fällig am 25.10.2029 | € | 600 | 681 | 0,10 |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | |
| 0,012 % fällig am 20.05.2024 | | 31 | 35 | 0,01 |
| 0,012 % fällig am 20.10.2024 | | 207 | 237 | 0,03 |
| 0,024 % fällig am 15.07.2026 | | 300 | 342 | 0,05 |
| **Bayview Financial Asset Trust** | | | | |
| 3,977 % fällig am 25.03.2037 | $ | 172 | 175 | 0,03 |
| **Bayview Opportunity Master Fund Trust** | | | | |
| 4,213 % fällig am 29.10.2033 | | 650 | 657 | 0,10 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 3,054 % fällig am 25.03.2035 | | 989 | 997 | 0,15 |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | |
| 1,310 % fällig am 20.09.2028 | £ | 1.100 | 1.402 | 0,21 |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | € | 500 | 571 | 0,08 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,780 % fällig am 25.10.2037 | $ | 105 | 107 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.07.2037 | | 285 | 260 | 0,04 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 460 | 385 | 0,06 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,864 % fällig am 25.05.2036 | | 397 | 398 | 0,06 |
| **Crown Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,713 % fällig am 17.07.2028 | | 1.700 | 1.692 | 0,25 |
| **CVC Cordatus Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 0,970 % fällig am 22.04.2030 | € | 250 | 286 | 0,04 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | | 100 | 114 | 0,02 |
| **Driver Espana ET** | | | | |
| 0,011 % fällig am 21.04.2028 | | 106 | 121 | 0,02 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | | |
| 0,880 % fällig am 15.01.2030 | | 1.300 | 1.482 | 0,22 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.10.2027 | $ | 600 | 599 | 0,09 |
| **Encore Credit Receivables Trust** | | | | |
| 3,094 % fällig am 25.07.2035 | | 527 | 514 | 0,08 |
| **Evans Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 3,441 % fällig am 28.05.2028 | $ | 300 | $ 298 | 0,04 |
| **Flagship Ltd.** | | | | |
| 3,712 % fällig am 20.01.2026 | | 59 | 59 | 0,01 |
| **Flexi ABS Trust** | | | | |
| 2,275 % fällig am 23.06.2023 | AUD | 915 | 643 | 0,09 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 3,469 % fällig am 25.06.2035 | $ | 200 | 200 | 0,03 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | |
| 3,642 % fällig am 21.01.2028 | | 600 | 599 | 0,09 |
| **GLS Auto Receivables Trust** | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.08.2022 | | 681 | 684 | 0,10 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | € | 700 | 798 | 0,12 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.05.2046 | $ | 1.400 | 1.347 | 0,20 |
| 3,454 % fällig am 25.10.2034 | | 94 | 92 | 0,01 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 500 | 569 | 0,08 |
| **Holland Park CLO Ltd.** | | | | |
| 0,621 % fällig am 14.05.2027 | | 241 | 274 | 0,04 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.02.2036 | $ | 1.000 | 980 | 0,14 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.04.2037 | | 391 | 312 | 0,05 |
| **Jamestown CLO Ltd.** | | | | |
| 3,287 % fällig am 15.07.2026 | | 277 | 277 | 0,04 |
| **JMP Credit Advisors CLO Ltd.** | | | | |
| 3,438 % fällig am 17.01.2028 | | 900 | 896 | 0,13 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | € | 1.000 | 1.136 | 0,17 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.01.2036 | $ | 1.121 | 1.050 | 0,15 |
| **Loomis Sayles CLO Ltd.** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.04.2028 | | 1.100 | 1.095 | 0,16 |
| **Marathon CLO Ltd.** | | | | |
| 3,392 % fällig am 21.11.2027 | | 600 | 597 | 0,09 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.02.2037 | | 762 | 331 | 0,05 |
| 3,124 % fällig am 25.05.2036 | | 134 | 133 | 0,02 |
| **Monarch Grove CLO** | | | | |
| 3,460 % fällig am 25.01.2028 | | 900 | 896 | 0,13 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,474 % fällig am 25.10.2036 | | 1.074 | 657 | 0,10 |
| 2,529 % fällig am 25.07.2036 | | 99 | 87 | 0,01 |
| 3,004 % fällig am 25.12.2034 | | 478 | 478 | 0,07 |
| 3,364 % fällig am 25.09.2034 | | 1.283 | 1.291 | 0,19 |
| **Mountain Hawk CLO Ltd.** | | | | |
| 3,801 % fällig am 18.04.2025 | | 185 | 185 | 0,03 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,139 % fällig am 25.06.2035 | | 1.600 | 1.603 | 0,24 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,944 % fällig am 25.05.2036 | | 1.700 | 1.597 | 0,24 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | | |
| 3,438 % fällig am 17.04.2027 | | 500 | 499 | 0,07 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 | | 367 | 276 | 0,04 |
| 2,544 % fällig am 25.03.2037 | | 657 | 528 | 0,08 |
| **Palmer Square Loan Funding Ltd.** | | | | |
| 3,418 % fällig am 15.11.2026 | | 1.010 | 1.009 | 0,15 |
| **Penta CLO BV** | | | | |
| 0,790 % fällig am 04.08.2028 | € | 250 | 285 | 0,04 |
| **Purple Master Credit Cards** | | | | |
| 0,052 % fällig am 25.10.2030 | | 2.500 | 2.859 | 0,42 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,762 % fällig am 25.08.2036 | $ | 734 | 417 | 0,06 |
| **SC Germany Auto UG** | | | | |
| 0,023 % fällig am 13.12.2026 | € | 122 | 139 | 0,02 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | | |
| 0,074 % fällig am 17.03.2025 | | 100 | 114 | 0,02 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.01.2024 | | 184 | 210 | 0,03 |
| **SoFi Consumer Loan Program LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.05.2026 | $ | 107 | 107 | 0,02 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Sorrento Park CLO DAC** | | | | |
| 0,639 % fällig am 16.11.2027 | € | 242 | $ 276 | 0,04 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.11.2036 | $ | 1.200 | 1.132 | 0,17 |
| **Telos CLO Ltd.** | | | | |
| 3,858 % fällig am 17.01.2027 | | 296 | 297 | 0,04 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | | |
| 3,344 % fällig am 25.11.2033 | | 7 | 7 | 0,00 |
| **TICP CLO Ltd.** | | | | |
| 3,601 % fällig am 20.04.2028 | | 1.100 | 1.091 | 0,16 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,920 % fällig am 15.07.2030 | € | 700 | 799 | 0,12 |
| **Utah State Board of Regents** | | | | |
| 3,154 % fällig am 25.01.2057 | $ | 62 | 62 | 0,01 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 3,667 % fällig am 15.04.2027 | | 200 | 200 | 0,03 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | | 237 | 238 | 0,03 |
| | | | 45.781 | 6,76 |

## STAATSEMISSIONEN

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | |
| 1,375 % fällig am 17.09.2024 | € | 1.100 | 1.356 | 0,20 |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | | 300 | 268 | 0,04 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | ARS | 4.680 | 95 | 0,01 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 8.100 | 187 | 0,03 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035 | € | 200 | 274 | 0,04 |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | | 1.000 | 1.232 | 0,18 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 1.450 | 1.698 | 0,25 |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | |
| 0,747 % fällig am 30.04.2022 | | 900 | 1.054 | 0,16 |
| 1,773 % fällig am 30.04.2028 | | 1.500 | 1.906 | 0,28 |
| **Belgien Government International Bond** | | | | |
| 1,250 % fällig am 22.04.2033 | | 2.000 | 2.554 | 0,38 |
| **China Development Bank** | | | | |
| 3,050 % fällig am 25.08.2026 | CNY | 4.700 | 653 | 0,10 |
| 3,180 % fällig am 05.04.2026 | | 12.600 | 1.772 | 0,26 |
| 3,680 % fällig am 26.02.2026 | | 18.600 | 2.698 | 0,40 |
| 3,740 % fällig am 10.09.2025 | | 3.200 | 466 | 0,07 |
| 4,040 % fällig am 10.04.2027 | | 9.400 | 1.387 | 0,21 |
| 4,040 % fällig am 06.07.2028 | | 2.200 | 325 | 0,05 |
| 4,150 % fällig am 26.10.2025 | | 2.400 | 358 | 0,05 |
| 4,240 % fällig am 24.08.2027 | | 17.300 | 2.589 | 0,38 |
| 4,880 % fällig am 09.02.2028 | | 17.800 | 2.786 | 0,41 |
| **China Government International Bond** | | | | |
| 2,740 % fällig am 04.08.2026 | | 500 | 70 | 0,01 |
| 2,950 % fällig am 16.06.2023 | | 1.500 | 219 | 0,03 |
| 3,220 % fällig am 06.12.2025 | | 1.500 | 218 | 0,03 |
| 3,290 % fällig am 18.10.2023 | | 4.500 | 663 | 0,10 |
| **CPPIB Capital, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 25.01.2022 | $ | 250 | 252 | 0,04 |
| **Development Bank of Japan, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 18.10.2022 | | 2.600 | 2.636 | 0,39 |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | | 700 | 706 | 0,10 |
| 3,125 % fällig am 11.10.2027 | | 400 | 416 | 0,06 |
| **Export Development Canada** | | | | |
| 1,800 % fällig am 01.09.2022 | CAD | 1.500 | $ 1.154 | 0,17 |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 25.05.2048 | € | 2.000 | 2.933 | 0,43 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 17.01.2028 | $ | 300 | 317 | 0,05 |
| 4,125 % fällig am 17.01.2048 | | 200 | 219 | 0,03 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,450 % fällig am 15.11.2024 | € | 2.200 | 2.516 | 0,37 |
| 2,100 % fällig am 15.07.2026 | | 2.800 | 3.279 | 0,48 |
| 2,450 % fällig am 01.10.2023 | | 2.600 | 3.122 | 0,46 |
| 2,500 % fällig am 15.11.2025 | | 1.400 | 1.685 | 0,25 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2029 | | 3.600 | 4.447 | 0,66 |
| 3,450 % fällig am 01.03.2048 | | 200 | 251 | 0,04 |
| **Japan Bank for International Cooperation** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.11.2022 | $ | 200 | 202 | 0,03 |
| 3,250 % fällig am 20.07.2023 | | 600 | 628 | 0,09 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 2,125 % fällig am 13.04.2021 | | 600 | 600 | 0,09 |
| 2,625 % fällig am 20.04.2022 | | 1.900 | 1.925 | 0,28 |
| 3,000 % fällig am 12.03.2024 | | 500 | 518 | 0,08 |
| 3,375 % fällig am 27.09.2023 | | 200 | 209 | 0,03 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (e) | ¥ | 454.469 | 4.406 | 0,65 |
| 0,100 % fällig am 20.03.2029 | | 630.000 | 6.000 | 0,89 |
| 0,500 % fällig am 20.09.2046 | | 437.000 | 4.234 | 0,63 |
| 0,500 % fällig am 20.03.2049 | | 608.000 | 5.863 | 0,87 |
| 0,700 % fällig am 20.12.2048 | | 1.002.000 | 10.183 | 1,49 |
| 1,400 % fällig am 20.09.2034 | | 350.000 | 3.902 | 0,58 |
| **Kuwait International Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.03.2022 | $ | 300 | 305 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2027 | | 1.000 | 1.066 | 0,16 |
| **Lithuania Government International Bond** | | | | |
| 6,125 % fällig am 09.03.2021 | | 800 | 850 | 0,13 |
| **Malaysia Government International Bond** | | | | |
| 3,654 % fällig am 31.10.2019 | MYR | 9.100 | 2.207 | 0,33 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 3.100 | 1.029 | 0,15 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 2.100 | 703 | 0,10 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 5.400 | 1.845 | 0,27 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** | | | | |
| 4,450 % fällig am 20.02.2029 | $ | 1.700 | 1.823 | 0,27 |
| **Poland Government International Bond** | | | | |
| 2,250 % fällig am 25.04.2022 | PLN | 400 | 109 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 25.07.2025 | | 1.000 | 285 | 0,04 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 1,650 % fällig am 03.03.2022 | CAD | 1.800 | 1.378 | 0,20 |
| 2,450 % fällig am 01.03.2023 | | 2.000 | 1.570 | 0,23 |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 500 | 405 | 0,06 |
| **Regie Autonome des Transports Parisiens** | | | | |
| 0,875 % fällig am 25.05.2027 | € | 300 | 364 | 0,05 |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 7,250 % fällig am 10.05.2034 | RUB | 90.100 | 1.410 | 0,21 |
| 7,650 % fällig am 10.04.2030 | | 121.900 | 1.982 | 0,29 |
| 7,950 % fällig am 07.10.2026 | | 129.200 | 2.126 | 0,31 |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 1,188 % fällig am 14.03.2029 | € | 700 | 875 | 0,13 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 928 | 1.044 | 0,15 |
| **Societe Du Grand Paris EPIC** | | | | |
| 1,125 % fällig am 22.10.2028 | € | 1.500 | $ 1.862 | 0,28 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 0,250 % fällig am 30.07.2024 | | 2.400 | 2.791 | 0,41 |
| 0,600 % fällig am 31.10.2029 | | 5.100 | 5.897 | 0,87 |
| 1,400 % fällig am 30.07.2028 | | 4.300 | 5.372 | 0,79 |
| 2,700 % fällig am 31.10.2048 | | 600 | 899 | 0,13 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.05.2021 | $ | 300 | 299 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 08.06.2022 | | 900 | 910 | 0,13 |
| 2,625 % fällig am 29.05.2024 | | 200 | 204 | 0,03 |
| | | | 127.041 | 18,74 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Global Investors Series PLC - Global Investment Grade Credit ESG Fund (g)** | | 580.000 | 5.823 | 0,86 |

## VORZUGSWERTPAPIERE

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % | | 750 | 145 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (k)** | | | | |
| | | | 31.038 | 4,58 |
| **ITALY TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,198) % fällig am 12.07.2019 (c)(d) | € | 4.900 | 5.581 | 0,83 |
| (0,198) % fällig am 31.07.2019 (c)(d) | | 3.700 | 4.214 | 0,62 |
| | | | 9.795 | 1,45 |
| **JAPAN TREASURY BILLS** | | | | |
| (0,175) % fällig am 22.07.2019 (c)(d) | ¥ | 3.478.000 | 32.284 | 4,77 |
| (0,160) % fällig am 13.08.2019 (c)(d) | | 180.000 | 1.671 | 0,25 |
| (0,155) % fällig am 29.07.2019 (c)(d) | | 330.000 | 3.063 | 0,45 |
| (0,153) % fällig am 19.08.2019 (c)(d) | | 1.140.000 | 10.583 | 1,56 |
| (0,144) % fällig am 16.07.2019 (c)(d) | | 360.000 | 3.341 | 0,49 |
| | | | 50.942 | 7,52 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 91.775 | 13,55 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 838.830** | **123,81** |

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

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

## FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 84 | $ 20 | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 4 | 2 | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 4 | (6) | 0,00 |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09/2019 | 116 | 100 | 0,01 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2019 | 59 | (358) | (0,05) |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 12 | 77 | 0,01 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 283 | (1.023) | (0,15) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 498 | 798 | 0,12 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 471 | 1.003 | 0,15 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 81 | 727 | 0,11 |

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate September Futures | Long | 09/2019 | 822 | $ 459 | 0,07 |
| United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate September Futures | Short | 09/2020 | 822 | (831) | (0,12) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 55 | 12 | 0,00 |
| | | | | $ 980 | 0,15 |

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | $ 110,000 | 23.08.2019 | 27 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 111,500 | 23.08.2019 | 7 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,000 | 23.08.2019 | 94 | 1 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,500 | 23.08.2019 | 14 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 113,500 | 23.08.2019 | 14 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 114,000 | 23.08.2019 | 132 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 3 | $ 0 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 127,000 | 26.07.2019 | 38 | $ (16) | $ (46) | (0,01) |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 125,500 | 26.07.2019 | 75 | (25) | (4) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 75 | (26) | (20) | 0,00 |
| | | | | $ (67) | $ (70) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 910** | **0,14** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Tesco PLC | 1,000 % | 20.06.2022 | € 100 | $ 4 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2025 | 300 | 6 | 0,00 |
| | | | | $ 10 | 0,00 |

**ZINSSWAPS - BASISSWAPS**

| Zahlung variabler Zinssatzindex | Erhalt variabler Zinssatzindex | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,117 % | 02.03.2020 | $ 92.400 | $ 27 | 0,01 |
| 3-Month USD-LIBOR[3] | 1-Month USD-LIBOR + 9,125 % | 18.03.2022 | 160.300 | 17 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[3] | 1-Month USD-LIBOR + 8,375 % | 26.04.2022 | 21.400 | 4 | 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 + 0,070 % | 12.06.2022 | 1.100 | 1 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,085 % | 19.06.2022 | 5.300 | 4 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[3] | 1-Month USD-LIBOR + 8,625 % | 12.04.2023 | 13.600 | 3 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[3] | 1-Month USD-LIBOR + 7,250 % | 27.04.2023 | 13.700 | 3 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[3] | 1-Month USD-LIBOR + 8,800 % | 23.05.2029 | 7.400 | (2) | 0,00 |
| | | | | $ 58 | 0,01 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,673 % | 30.04.2025 | $ 900 | $ (57) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,683 | 30.04.2025 | 2.800 | (181) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,684 | 30.04.2025 | 900 | (58) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,696 | 30.04.2025 | 900 | (58) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,710 | 30.04.2025 | 1.000 | (66) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,714 | 30.04.2025 | 1.900 | (125) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,370 | 02.01.2020 | BRL 108.900 | (50) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,450 | 02.01.2020 | 168.600 | (101) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,500 | 19.06.2029 | CAD 24.000 | 728 | 0,11 |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 2,500 | 14.02.2020 | NZD 3.650 | 29 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month PLN-WIBOR | 2,405 | 30.01.2029 | PLN 1.300 | 10 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 20.06.2020 | $ 12.000 | (190) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 20.12.2019 | 700 | 4 | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,460 % | 09.04.2024 | $ 1.400 | $ (43) | (0,01) |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 18.12.2024 | 2.700 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 5.400 | (888) | (0,13) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2020 | 6.700 | (138) | (0,02) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 18.12.2029 | 1.300 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 4.600 | (541) | (0,08) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 1.000 | 3 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2026 | 8.100 | (394) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 19.800 | (1.215) | (0,18) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 3.600 | (18) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 3.900 | (775) | (0,11) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 18.12.2049 | 600 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,250 | 20.06.2023 | ZAR 11.400 | 6 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,912 | 30.01.2029 | CZK 7.400 | 9 | 0,00 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.09.2021 | € 52.150 | (146) | (0,02) |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2021 | 39.400 | (26) | 0,00 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2024 | 11.200 | 54 | 0,01 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | 20.000 | 398 | 0,06 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 18.12.2029 | 30.900 | 351 | 0,05 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | 9.600 | 301 | 0,05 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 08.03.2029 | 11.500 | 369 | 0,06 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | 1.575 | 22 | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,310 | 19.06.2029 | 24.500 | 241 | 0,04 |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.09.2021 | £ 1.100 | (9) | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2024 | 14.600 | 17 | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2029 | 3.200 | (12) | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2029 | 2.100 | 7 | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 900 | 92 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,200 | 19.06.2029 | ¥ 750.000 | (56) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,400 | 19.06.2039 | 550.000 | (127) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,500 | 19.06.2049 | 620.000 | 199 | 0,03 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,825 | 12.01.2023 | MXN 2.500 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,730 | 25.02.2027 | 8.000 | (8) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,005 | 21.12.2027 | 5.000 | 6 | 0,00 |
| | | | | | $ (2.423) | (0,36) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (2.355)** | **(0,35)** |

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**DEVISENOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| HUS | Call - OTC AUD versus CAD | CAD 0,940 | 13.09.2019 | 4.200 | $ 12 | $ 8 | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus INR | INR 82,000 | 16.10.2019 | 8.000 | 56 | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ 68 | $ 9 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**DEVISENOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Put - OTC USD versus COP | COP 3.165,000 | 29.08.2019 | 2.160 | $ (18) | $ (18) | 0,00 |
| | Put - OTC USD versus ZAR | ZAR 14,200 | 18.07.2019 | 1.340 | (7) | (21) | (0,01) |
| HUS | Put - OTC AUD versus CAD | CAD 0,905 | 13.09.2019 | 4.200 | (13) | (17) | 0,00 |
| | Put - OTC USD versus CNH | CNH 6,795 | 22.07.2019 | 3.200 | (8) | (7) | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus CNH | 6,945 | 22.07.2019 | 3.200 | (6) | (10) | 0,00 |
| | | | | | $ (52) | $ (73) | (0,01) |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Japan Government International Bond | (1,000)% | 20.06.2022 | $ 100 | $ (4) | $ 1 | $ (3) | 0,00 |
| BPS | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 100 | (3) | 0 | (3) | 0,00 |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.500 | (37) | (7) | (44) | (0,01) |
| BRC | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 600 | (11) | (5) | (16) | 0,00 |
| | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 300 | (10) | 2 | (8) | 0,00 |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.900 | (48) | (8) | (56) | (0,01) |
| CBK | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 800 | (29) | 8 | (21) | 0,00 |
| GST | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.300 | (25) | (9) | (34) | (0,01) |
| | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 500 | (17) | 4 | (13) | 0,00 |
| HUS | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 600 | (15) | (3) | (18) | 0,00 |
| JPM | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 900 | (22) | (4) | (26) | (0,01) |
| | | | | | $ (221) | $ (21) | $ (242) | (0,04) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 800 | $ (35) | $ 10 | $ (25) | 0,00 |
| JPM | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 300 | (16) | 12 | (4) | 0,00 |
| | | | | | $ (51) | $ 22 | $ (29) | 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 | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,180 % | 30.01.2024 | ILS 3.000 | $ 0 | $ 22 | $ 22 | 0,01 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,786 | 01.05.2029 | 1.200 | 0 | 10 | 10 | 0,00 |
| CBK | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,755 | 29.04.2029 | 2.100 | 0 | 16 | 16 | 0,00 |
| GLM | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,779 | 30.04.2029 | 1.800 | 0 | 15 | 15 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,780 | 22.04.2029 | 1.800 | 0 | 16 | 16 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,718 | 19.06.2029 | KRW 523.700 | 0 | 12 | 12 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,785 | 20.03.2029 | 3.569.000 | 0 | 103 | 103 | 0,02 |
| HUS | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,785 | 25.04.2029 | ILS 2.300 | 0 | 20 | 20 | 0,00 |
| JPM | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,775 | 25.04.2029 | 2.100 | 1 | 17 | 18 | 0,00 |
| NGF | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,725 | 20.03.2024 | KRW 3.205.000 | 0 | 40 | 40 | 0,01 |
| SCX | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,785 | 20.03.2029 | 760.000 | 23 | (1) | 22 | 0,01 |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,795 | 20.03.2029 | 554.000 | 0 | 17 | 17 | 0,00 |
| | | | | | | $ 24 | $ 287 | $ 311 | 0,05 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| AZD | 07/2019 | CNH | 1.412 | $ | 208 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.280 | ¥ | 140.000 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| BOA | 07/2019 | AUD | 817 | $ | 560 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 1.536 | | 1.155 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 1.427 | | 1.618 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 73.900 | | 682 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | RON | 3.197 | € | 657 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 9.042 | AUD | 12.957 | 50 | 0 | 50 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 7.765 | CAD | 10.213 | 51 | 0 | 51 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 140.844 | € | 123.939 | 299 | 0 | 299 | 0,04 |
| | 07/2019 | | 544 | £ | 428 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 32 | NOK | 277 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.869 | NZD | 4.411 | 94 | 0 | 94 | 0,01 |
| | 08/2019 | AUD | 9.159 | $ | 6.403 | 0 | (32) | (32) | (0,01) |
| | 08/2019 | CAD | 10.213 | | 7.770 | 0 | (51) | (51) | (0,01) |
| | 08/2019 | € | 123.881 | | 141.137 | 0 | (299) | (299) | (0,04) |
| | 09/2019 | SGD | 3.763 | | 2.749 | 0 | (35) | (35) | (0,01) |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond ESG Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 03/2020 | RON | 1.837 | € | 370 | $ 0 | $ (9) | $ (9) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | AUD | 4.034 | $ | 2.809 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 874 | | 664 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 1.283 | | 1.318 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 3.770 | | 574 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 10.134 | | 11.417 | 3 | (128) | (125) | (0,02) |
| | 07/2019 | £ | 653 | | 833 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 103.087 | | 965 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 287 | | 33 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | RON | 6.429 | | 1.526 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 123.665 | | 1.907 | 0 | (50) | (50) | (0,01) |
| | 07/2019 | SEK | 1.535 | | 163 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 682 | CNH | 4.674 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.699 | € | 1.511 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 39.801 | £ | 31.380 | 136 | 0 | 136 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 1.590 | NOK | 13.620 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 31.380 | $ | 39.862 | 0 | (138) | (138) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ | 376 | ARS | 16.786 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | € | 52 | TRY | 353 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 3.059 | CNH | 21.215 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.075 | IDR | 15.517.972 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 25 | PEN | 84 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | INR | 137.083 | $ | 1.948 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 1.602 | € | 323 | 0 | (8 | (8) | 0,00 |
| | 05/2020 | $ | 4.767 | INR | 350.231 | 115 | 0 | 115 | 0,02 |
| BRC | 07/2019 | DKK | 13.475 | $ | 2.053 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 2.018 | | 2.573 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 330.000 | | 2.971 | 0 | (98) | (98) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 654 | € | 578 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 655.000 | $ | 6.010 | 0 | (91) | (91) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 703 | HKD | 5.499 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 10 | IDR | 144.380 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 5.499 | $ | 703 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 04/2020 | INR | 352.151 | | 4.854 | 0 | (59) | (59) | (0,01) |
| CBK | 07/2019 | AUD | 8.912 | | 6.175 | 0 | (79) | (79) | (0,01) |
| | 07/2019 | CHF | 1.746 | | 1.751 | 0 | (40) | (40) | (0,01) |
| | 07/2019 | CLP | 175.739 | | 259 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | CNH | 4.892 | | 726 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 30.710 | | 4.671 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 16.781 | | 18.852 | 0 | (269) | (269) | (0,04) |
| | 07/2019 | ¥ | 3.478.000 | | 31.282 | 0 | (1.051) | (1.051) | (0,16 |
| | 07/2019 | KRW | 1.555.275 | | 1.335 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 42.251 | | 4.919 | 7 | (44) | (37) | (0,01) |
| | 07/2019 | PEN | 2.981 | | 894 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 92.594 | | 1.438 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| | 07/2019 | SEK | 22.151 | | 2.357 | 0 | (31) | (31) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 1.746 | AUD | 2.510 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 569 | CAD | 755 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 682 | CNH | 4.674 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.695 | COP | 9.109.394 | 142 | 0 | 142 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 20.192 | DKK | 132.762 | 65 | 0 | 65 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 544 | € | 479 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.017 | £ | 2.377 | 9 | (1) | 8 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 576 | ¥ | 62.330 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.396 | PLN | 8.943 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5.068 | SEK | 47.445 | 46 | 0 | 46 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 234 | TRY | 1.362 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 94.708 | $ | 4.786 | 0 | (109) | (109) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ | 1.308 | HKD | 10.243 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 6.402 | ¥ | 690.000 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 5.504 | MXN | 108.181 | 88 | 0 | 88 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 3.211 | NOK | 27.285 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 41.959 | $ | 6.045 | 0 | (57) | (57) | (0,01) |
| | 09/2019 | € | 190 | TRY | 1.291 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 2.515 | $ | 322 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 259 | CLP | 175.739 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 47 | PEN | 156 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 132.762 | $ | 20.348 | 0 | (64) | (64) | (0,01) |
| | 10/2019 | $ | 1.208 | RON | 5.178 | 36 | 0 | 36 | 0,01 |
| | 11/2019 | | 256 | TWD | 7.977 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 10.243 | $ | 1.309 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 1.613 | € | 325 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| FBF | 11/2019 | $ | 307 | TWD | 9.585 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | CHF | 778 | $ | 802 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | CLP | 911.611 | | 1.345 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | COP | 9.109.394 | | 2.859 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 1.440 | | 217 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 88.748 | | 99.094 | 0 | (1.972) | (1.972) | (0,29) |
| | 07/2019 | £ | 1.372 | | 1.742 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 27.382 | | 255 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 127.581 | | 1.951 | 0 | (68) | (68) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 860 | CLP | 598.044 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | $ | 582 | NZD | 884 | $ 12 | $ 0 | $ 12 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 220 | PEN | 735 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.083 | RUB | 71.884 | 55 | 0 | 55 | 0,01 |
| | 08/2019 | ¥ | 180.000 | $ | 1.650 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 17.741 | | 893 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 08/2019 | RUB | 170.104 | | 2.584 | 0 | (91) | (91) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 5.081 | RUB | 334.009 | 181 | 0 | 181 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 1.345 | CLP | 911.611 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 317 | IDR | 4.579.065 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 2.846 | COP | 9.109.394 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 10.213 | $ | 7.576 | 0 | (239) | (239) | (0,04) |
| | 07/2019 | CNH | 32.613 | | 4.778 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 65.785 | | 9.991 | 0 | (46) | (46) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 77 | | 88 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 1.769 | | 1.171 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 582 | CAD | 783 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.905 | CNH | 33.666 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.303 | NOK | 20.062 | 50 | 0 | 50 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 386 | RUB | 24.783 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.285 | TRY | 7.437 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | HKD | 42.026 | $ | 5.373 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.393 | HKD | 10.916 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 637 | MXN | 12.268 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 105.346 | $ | 15.160 | 0 | (161) | (161) | (0,02) |
| | 09/2019 | $ | 4.696 | CNH | 32.335 | 14 | (7) | 7 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 217 | IDR | 3.136.301 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 10/2019 | INR | 113.928 | $ | 1.550 | 0 | (78) | (78) | (0,01) |
| | 10/2019 | MXN | 12.268 | | 631 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 3.464 | INR | 251.011 | 123 | 0 | 123 | 0,02 |
| | 10/2019 | | 626 | MXN | 12.268 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 1.209 | RON | 5.157 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 68.577 | $ | 2.191 | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| | 11/2019 | $ | 557 | TWD | 17.364 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 22.028 | $ | 2.817 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 03/2020 | € | 239 | RON | 1.163 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 04/2020 | $ | 4.799 | INR | 352.151 | 114 | 0 | 114 | 0,02 |
| JPM | 07/2019 | CHF | 1.154 | $ | 1.153 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 18.155 | | 2.748 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 1.940 | RON | 9.197 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 15.708 | $ | 17.740 | 0 | (148) | (148) | (0,02) |
| | 07/2019 | £ | 1.773 | | 2.232 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 07/2019 | INR | 336.074 | | 4.791 | 0 | (75) | (75) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 2.718.987 | | 24.964 | 0 | (273) | (273) | (0,04) |
| | 07/2019 | KRW | 543.962 | | 467 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.368 | CHF | 2.339 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 940 | £ | 746 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.832 | INR | 336.074 | 34 | 0 | 34 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.607 | NOK | 13.665 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 672 | PEN | 2.247 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 836 | PLN | 3.122 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 579 | SEK | 5.502 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 254 | TRY | 1.474 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.041 | ZAR | 44.196 | 91 | 0 | 91 | 0,01 |
| | 08/2019 | MXN | 8.414 | $ | 424 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 3.103 | | 447 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 641 | IDR | 9.251.432 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 9.197 | € | 1.923 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 18.616 | $ | 594 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 05/2020 | INR | 174.965 | | 2.428 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | CNH | 4.098 | | 600 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 90 | RON | 429 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | PLN | 1.578 | $ | 419 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 257 | CLP | 175.739 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 179 | COP | 585.518 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.501 | RUB | 99.314 | 57 | 0 | 57 | 0,01 |
| | 11/2019 | MYR | 9.266 | $ | 2.217 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 1.616 | € | 325 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | AUD | 1.693 | $ | 1.180 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 599 | | 601 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 21.819 | | 2.572 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 820 | HKD | 6.422 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 6.422 | $ | 821 | 0 | (2) ) | (2) | 0,00 |
| | 06/2021 | $ | 29 | € | 23 | 0 | (2 | (2) | 0,00 |
| NGF | 09/2019 | TRY | 1.647 | | 242 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| RBC | 07/2019 | COP | 1.436.146 | $ | 452 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 4.900 | | 5.495 | 0 | (90) | (90) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 266 | COP | 850.628 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 174 | ZAR | 2.541 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 450 | COP | 1.436.146 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | | 453 | CLP | 313.567 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 474 | $ | 351 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 28.583 | | 36.177 | 0 | (200) | (200) | (0,03) |
| | 07/2019 | ¥ | 314.394 | | 2.898 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | KRW | 1.165 | $ | 1 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | SEK | 202.727 | | 21.186 | 0 | (663) | (663) | (0,10) |
| | 07/2019 | $ | 2.862 | £ | 2.266 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.178 | ¥ | 127.631 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 723 | RUB | 47.951 | 36 | 0 | 36 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 22.026 | SEK | 204.262 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 204.262 | $ | 22.078 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 8.759 | | 1.263 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 3.878 | | 496 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 241 | | 176 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 823 | CNH | 5.693 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 2.563 | IDR | 37.392.637 | 58 | 0 | 58 | 0,01 |
| | 11/2019 | | 1.632 | TWD | 50.745 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 05/2020 | INR | 175.266 | $ | 2.440 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | ¥ | 500.000 | | 4.512 | 0 | (134) | (134) | (0,02) |
| | 07/2019 | NZD | 3.513 | | 2.326 | 0 | (33) | (33) | (0,01) |
| | 07/2019 | TRY | 10.273 | | 1.724 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 224 | € | 200 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 629 | £ | 500 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 25.016 | ¥ | 2.692.519 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 08/2019 | HKD | 7.435 | $ | 951 | 0 | (1 | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 3.867.519 | | 35.859 | 24 | (161) | (137) | (0,02) |
| | 09/2019 | TWD | 5.536 | | 177 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 1.230 | | 288 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 03/2020 | € | 1.131 | RON | 5.504 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | | | $ 2.537 | $ (7.879) | $ (5.342) | (0,79) |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 7.277 | $ | 5.081 | $ 0 | $ (25) | $ (25) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4.097 | AUD | 5.912 | 52 | 0 | 52 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 4.899 | | 7.007 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 7.013 | $ | 4.905 | 0 | (16) ) | (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4.263 | AUD | 6.158 | 58 | 0 | 58 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 4.911 | | 7.013 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 28 | | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | AUD | 10 | $ | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.433 | AUD | 2.073 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 389 | | 557 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 4.396 | | 6.338 | 52 | 0 | 52 | 0,01 |
| | | | | | | $ 227 | $ (41 | $ 186 | 0,03 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | $ | 645 | CHF | 647 | $ 19 | $ 0 | $ 19 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF | 661 | $ | 675 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 597 | CHF | 598 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 677 | | 661 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 629 | | 634 | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 644 | $ | 659 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 661 | CHF | 644 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 72 | | 71 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 60 | $ (4) | $ 56 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | € | 88.279 | $ | 100.320 | $ 0 | $ (212) | $ (212) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ | 100.576 | € | 88.279 | 213 | 0 | 213 | 0,03 |
| BPS | 07/2019 | € | 87.982 | $ | 100.012 | 0 | (183) | (183) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 17.305 | € | 15.389 | 221 | (1) | 220 | 0,03 |
| | 08/2019 | | 96.797 | | 84.917 | 154 | 0 | 154 | 0,02 |
| BRC | 07/2019 | | 90.007 | | 80.479 | 1.643 | 0 | 1.643 | 0,24 |
| CBK | 07/2019 | € | 88.279 | $ | 100.329 | 0 | (203) | (203) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 5.057 | € | 4.479 | 44 | (1) | 43 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 100.585 | | 88.279 | 204 | 0 | 204 | 0,03 |
| GLM | 07/2019 | | 88.321 | | 79.135 | 1.798 | 0 | 1.798 | 0,27 |
| MYI | 07/2019 | | 89.992 | | 80.479 | 1.658 | 0 | 1.658 | 0,24 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| RBC | 07/2019 | $ | 251 | € | 222 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | € | 131 | $ | 148 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.060 | € | 1.821 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 3.233 | | 2.874 | 40 | 0 | 40 | 0,01 |
| | | | | | | $ 5.990 | $ (601) | $ 5.389 | 0,79 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | £ | 27 | $ | 34 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.448 | £ | 1.935 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 5.668 | $ | 7.189 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 5.930 | £ | 4.703 | 56 | 0 | 56 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 7.198 | | 5.666 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | £ | 5.625 | $ | 7.147 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.537 | £ | 2.003 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 7.158 | | 5.625 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 90 | | 71 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 2.893 | | 2.285 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 7.288 | | 5.779 | 66 | 0 | 66 | 0,01 |
| | | | | | | $ 201 | $ (37) | $ 164 | 0,02 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 2.432 | NOK | 21.180 | $ 52 | $ 0 | $ 52 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | NOK | 57.125 | $ | 6.670 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 74.132 | NOK | 649.982 | 2.103 | 0 | 2.103 | 0,31 |
| BRC | 07/2019 | NOK | 701.062 | $ | 82.400 | 174 | 0 | 174 | 0,03 |
| | 08/2019 | $ | 82.486 | NOK | 701.062 | 0 | (174) | (174) | (0,03) |
| CBK | 07/2019 | NOK | 700.403 | $ | 82.328 | 180 | 0 | 180 | 0,03 |
| | 08/2019 | $ | 82.413 | NOK | 700.403 | 0 | (178) | (178) | (0,03) |
| JPM | 07/2019 | | 77.748 | | 679.828 | 1.987 | 0 | 1.987 | 0,29 |
| SCX | 07/2019 | | 89.287 | | 778.201 | 2.048 | (62) | 1.986 | 0,29 |
| | | | | | | $ 6.544 | $ (444) | $ 6.100 | 0,90 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | 07/2019 | $ | 10.180 | NZD | 15.598 | $ 297 | $ 0 | $ 297 | 0,04 |
| HUS | 07/2019 | | 10.864 | | 16.639 | 311 | 0 | 311 | 0,05 |
| MYI | 07/2019 | | 10.562 | | 16.183 | 307 | 0 | 307 | 0,05 |
| SCX | 07/2019 | NZD | 16.349 | $ | 10.936 | 0 | (45) | (45) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 10.943 | NZD | 16.349 | 46 | 0 | 46 | 0,01 |
| | | | | | | $ 961 | $ (45) | $ 916 | 0,14 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 7.445** | **1,10** |
| **Summe Anlagen** | **$ 844.830** | **124,70** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (167.334)** | **(24,70)** |
| **Nettovermögen** | **$ 677.496** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(c) Nullkuponwertpapier.**

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

**(e) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

**(g) Mit dem Fonds verbunden.**

**(h) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 10.942 als Sicherheiten verpfändet.**

**(j) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 20.789 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 290 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 5.492 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 1.710 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,700% | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 29.400 | U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2047 | $ (30.036) | $ 29.400 | $ 29.406 | 4,34 |
| FICC | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 1.638 | U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2021 | (1.672) | 1.638 | 1.638 | 0,24 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (31.708)** | **$ 31.038** | **$ 31.044** | **4,58** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert (1)**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 5.823 | $ 831.305 | $ 1.702 | $ 838.830 |
| Finanzderivate[3] | 910 | 5.090 | 0 | 6.000 |
| **Summen** | **$ 6.733** | **$ 836.395** | **$ 1.702** | **$ 844.830** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 628.700 | $ 175 | $ 628.875 |
| Finanzderivate[3] | (1.207) | (5.343) | 0 | (6.550) |
| **Summen** | **$ (1.207)** | **$ 623.357** | **$ 175** | **$ 622.325** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Verbindlich-keiten aus Pensions-geschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| GRE | 2,560% | 17.05.2019 | 17.07.2019 | $ (622) | $ (624) | (0,09) |
| | 2,610 | 29.05.2019 | 10.07.2019 | (1.908) | (1.912) | (0,28) |
| SCX | 2,710 | 14.06.2019 | 05.07.2019 | (8.344) | (8.355) | (1,24) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (10.891)** | **(1,61)** |

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-geschäfte[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPG | 2,580% | 13.06.2019 | 25.07.2019 | $ (7.112) | $ (7.121) | (1,05) |
| | 2,660 | 10.06.2019 | 10.07.2019 | (1.290) | (1.292) | (0,19) |
| | 2,660 | 11.06.2019 | 10.07.2019 | (12.250) | (12.269) | (1,81) |
| **Summe Rückkaufgeschäfte** | | | | | **$ (20.682)** | **(3,05)** |

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 21 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| AZD | $ 23 | $ 0 | $ 23 |
| BOA | 141 | 0 | 141 |
| BPS | 2.250 | (2.550) | (300) |
| BRC | 1.321 | (1.420) | (99) |
| CBK | (1.233) | 1.370 | 137 |
| FBF | 4 | 0 | 4 |
| GLM | 315 | (160) | 155 |
| GST | (72) | 0 | (72) |
| HUS | 121 | 40 | 161 |
| JPM | 1.556 | (1.880) | (324) |
| MSB | 32 | 0 | 32 |
| MYC | 0 | (340) | (340) |
| MYI | 1.956 | (1.890) | 66 |
| NGF | 42 | 0 | 42 |
| RBC | (84) | 40 | (44) |
| RYL | 22 | 0 | 22 |
| SCX | 1.426 | (1.840) | (414) |
| UAG | (375) | 260 | (115) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 67,48 | 64,24 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 51,75 | 54,87 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 4,58 | 5,08 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,14 | (0,24) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,35) | (0,18) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,10 | (0,87) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (1,61) | (5,15) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (3,05) | (1,75) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 44,41 | 42,92 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,19 | 0,30 |
| US-Regierungsbehörden | 26,83 | 28,69 |
| US-Schatzobligationen | 5,52 | 6,41 |
| Non-Agency-MBS | 6,93 | 7,11 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 6,76 | 8,00 |
| Staatsemissionen | 18,74 | 12,65 |
| Investmentfonds | 0,86 | 0,00 |
| Vorzugswertpapiere | 0,02 | 0,03 |
| Kurzfristige Instrumente | 13,55 | 18,08 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,15 | (0,24) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01 | 0,00 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Zinsswaps — Basisswaps | 0,01 | 0,01 |
| Zinsswaps | (0,36) | (0,19) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | 0,00 | 0,02 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | (0,01) | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | (0,04) | (0,04) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | (0,02) |
| Cross-Currency Swaps | 0,00 | 0,11 |
| Zinsswaps | 0,05 | (0,02) |
| Devisenterminkontrakte | (0,79) | (0,34) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,89 | (0,56) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (24,70) | (22,90) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **HSBC Bank Argentina S.A.** | | | | |
| 25,250 % fällig am 27.09.2019 | ARS | 4.700 | $ 101 | 0,01 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | € | 1.100 | 981 | 0,10 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | ARS | 2.190 | 44 | 0,01 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 9.250 | 213 | 0,02 |
| | | | 1.238 | 0,13 |
| Summe Argentinien | | | 1.339 | 0,14 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Driver Australia Four Trust** | | | | |
| 2,185 % fällig am 21.08.2025 | AUD | 362 | 254 | 0,03 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Volkswagen Financial Services Australia Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 22.06.2020 | | 2.600 | 1.844 | 0,19 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,511 % fällig am 16.09.2059 | | 1.346 | 942 | 0,10 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **New South Wales Treasury Corp.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.11.2025 | | 3.276 | 2.667 | 0,27 |
| Summe Australien | | | 5.707 | 0,59 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (f)(h) | € | 800 | 894 | 0,09 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,999 % fällig am 27.01.2028 | $ | 5.370 | 5.716 | 0,59 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank of Montreal** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.06.2021 | | 2.400 | 2.388 | 0,25 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | |
| 1,875 % fällig am 26.04.2021 | | 2.300 | 2.293 | 0,24 |
| **Canadian Imperial Bank of Commerce** | | | | |
| 3,150 % fällig am 27.06.2021 | | 1.400 | 1.429 | 0,15 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 3,110 % fällig am 15.06.2020 | | 700 | 702 | 0,07 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 1.200 | 1.467 | 0,15 |
| **HSBC Bank Canada** | | | | |
| 3,300 % fällig am 28.11.2021 | $ | 2.300 | 2.369 | 0,24 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 2,300 % fällig am 22.03.2021 | | 1.900 | 1.910 | 0,20 |
| | | | 12.558 | 1,30 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 2,078 % fällig am 01.06.2020 | CAD | 447 | 342 | 0,04 |
| 2,278 % fällig am 01.07.2020 | | 1.112 | 853 | 0,09 |
| 2,278 % fällig am 01.08.2020 | | 443 | 339 | 0,03 |
| **Real Estate Asset Liquidity Trust** | | | | |
| 3,072 % fällig am 12.08.2053 | | 898 | 699 | 0,07 |
| | | | 2.233 | 0,23 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (e)(j) | | 823 | 809 | 0,08 |
| **Province of Alberta** | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.11.2023 | $ | 400 | $ 422 | 0,04 |
| **Province of British Columbia** | | | | |
| 2,700 % fällig am 18.12.2022 | CAD | 800 | 633 | 0,07 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 2,450 % fällig am 29.06.2022 | $ | 400 | 406 | 0,04 |
| 3,150 % fällig am 02.06.2022 (j) | CAD | 6.200 | 4.940 | 0,51 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.09.2023 (j) | | 3.100 | 2.490 | 0,26 |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 (j) | | 2.000 | 1.620 | 0,17 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2021 (j) | | 1.600 | 1.299 | 0,13 |
| 5,000 % fällig am 01.12.2038 (j) | | 1.400 | 1.494 | 0,16 |
| | | | 14.113 | 1,46 |
| Summe Kanada | | | 28.904 | 2,99 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.10.2027 | $ | 2.400 | 2.397 | 0,25 |
| **Evans Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 3,441 % fällig am 28.05.2028 | | 600 | 597 | 0,06 |
| **Figueroa CLO Ltd.** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.01.2027 | | 2.411 | 2.409 | 0,25 |
| **Jamestown CLO Ltd.** | | | | |
| 3,287 % fällig am 15.07.2026 | | 1.110 | 1.107 | 0,11 |
| 3,467 % fällig am 15.01.2028 | | 2.300 | 2.293 | 0,24 |
| **LCM LP** | | | | |
| 3,632 % fällig am 20.10.2027 | | 2.200 | 2.200 | 0,23 |
| **Limerock CLO LLC** | | | | |
| 3,792 % fällig am 20.10.2026 | | 3.622 | 3.624 | 0,37 |
| **Loomis Sayles CLO Ltd.** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.04.2028 | | 2.500 | 2.487 | 0,26 |
| **Marathon CLO Ltd.** | | | | |
| 3,392 % fällig am 21.11.2027 | | 1.900 | 1.892 | 0,19 |
| **Mountain View CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.10.2026 | | 460 | 458 | 0,05 |
| **Telos CLO Ltd.** | | | | |
| 3,858 % fällig am 17.01.2027 | | 3.754 | 3.756 | 0,39 |
| **Tralee CLO Ltd.** | | | | |
| 3,702 % fällig am 20.10.2028 | | 2.500 | 2.494 | 0,26 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 3,667 % fällig am 15.04.2027 | | 500 | 499 | 0,05 |
| **WhiteHorse Ltd.** | | | | |
| 3,518 % fällig am 17.04.2027 | | 500 | 499 | 0,05 |
| | | | 26.712 | 2,76 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **KSA Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,894 % fällig am 20.04.2022 | | 800 | 810 | 0,08 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,872 % fällig am 31.05.2021 | | 1.300 | 1.318 | 0,14 |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 4.300 | 4.310 | 0,45 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 4.500 | 4.511 | 0,47 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | | 500 | 527 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 500 | 537 | 0,05 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 900 | 980 | 0,10 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 200 | 204 | 0,02 |
| **U.S. Capital Funding Ltd.** | | | | |
| 3,329 % fällig am 01.08.2034 | | 773 | 739 | 0,08 |
| | | | 13.936 | 1,44 |
| Summe Cayman Inseln | | | 40.648 | 4,20 |
| **CHINA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **China Development Bank** | | | | |
| 3,050 % fällig am 25.08.2026 | CNY | 8.400 | 1.167 | 0,12 |
| 3,180 % fällig am 05.04.2026 | | 22.300 | 3.135 | 0,32 |
| 3,680 % fällig am 26.02.2026 | | 33.700 | 4.889 | 0,51 |
| 3,740 % fällig am 10.09.2025 | | 5.600 | 816 | 0,08 |
| 4,040 % fällig am 10.04.2027 | | 17.500 | 2.583 | 0,27 |
| 4,040 % fällig am 06.07.2028 | | 6.100 | 902 | 0,09 |
| 4,150 % fällig am 26.10.2025 | | 4.200 | 626 | 0,07 |
| 4,240 % fällig am 24.08.2027 | | 29.200 | 4.370 | 0,45 |
| 4,880 % fällig am 09.02.2028 | CNY | 34.500 | $ 5.399 | 0,56 |
| **China Government International Bond** | | | | |
| 2,740 % fällig am 04.08.2026 | | 1.200 | 168 | 0,02 |
| 2,950 % fällig am 16.06.2023 | | 4.100 | 597 | 0,06 |
| 3,220 % fällig am 06.12.2025 | | 4.100 | 596 | 0,06 |
| 3,290 % fällig am 18.10.2023 | | 12.200 | 1.797 | 0,19 |
| Summe China | | | 27.045 | 2,80 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | DKK | 13.468 | 2.133 | 0,22 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 25.200 | 3.925 | 0,41 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 28.818 | 4.544 | 0,47 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 1.649 | 261 | 0,03 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 13.200 | 2.045 | 0,21 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 32.047 | 5.049 | 0,52 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 60 | 10 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2037 | | 5.257 | 833 | 0,09 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 59.000 | 9.171 | 0,95 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 8.481 | 1.338 | 0,14 |
| 2,000 % fällig am 01.10.2050 | | 14.988 | 2.358 | 0,24 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2036 | | 479 | 77 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 44 | 7 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 71.432 | 11.259 | 1,16 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2036 | | 361 | 58 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | | 70 | 11 | 0,00 |
| Summe Dänemark | | | 43.079 | 4,46 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Finnvera Oyj** | | | | |
| 0,625 % fällig am 22.09.2022 | € | 600 | 709 | 0,07 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Purple Master Credit Cards** | | | | |
| 0,052 % fällig am 25.10.2030 | | 3.000 | 3.430 | 0,36 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 17.01.2025 | | 2.700 | 3.185 | 0,33 |
| 1,875 % fällig am 15.09.2021 | $ | 1.500 | 1.496 | 0,15 |
| 2,250 % fällig am 18.02.2020 | | 1.500 | 1.500 | 0,15 |
| 3,250 % fällig am 26.09.2023 | | 2.000 | 2.095 | 0,22 |
| **Teleperformance** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.07.2025 | € | 300 | 360 | 0,04 |
| | | | 8.636 | 0,89 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 25.05.2048 (i) | | 10.100 | 14.812 | 1,53 |
| 3,250 % fällig am 25.05.2045 (i) | | 2.200 | 3.965 | 0,41 |
| | | | 18.777 | 1,94 |
| Summe Frankreich | | | 30.843 | 3,19 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Driver Multi-Compartment S.A.** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.02.2026 | | 648 | 740 | 0,08 |
| **Red & Black Auto Germany UG** | | | | |
| 0,124 % fällig am 15.09.2025 | | 775 | 885 | 0,09 |
| | | | 1.625 | 0,17 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aareal Bank AG** | | | | |
| 1,875 % fällig am 15.09.2020 | $ | 2.600 | 2.590 | 0,27 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 1.300 | 1.493 | 0,15 |
| 3,407 % fällig am 22.01.2021 | $ | 2.300 | 2.270 | 0,23 |
| 4,250 % fällig am 04.02.2021 | | 600 | 606 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 3.700 | 3.752 | 0,39 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Deutsche Pfandbriefbank AG** | | | | |
| 1,625 % fällig am 30.08.2019 | $ | 1.200 | $ 1.199 | 0,12 |
| 2,250 % fällig am 04.05.2020 | | 3.400 | 3.398 | 0,35 |
| 3,375 % fällig am 22.11.2021 | | 5.000 | 5.141 | 0,53 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c) | € | 1.300 | 1.517 | 0,16 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,250 % fällig am 15.09.2025 | | 1.200 | 1.417 | 0,15 |
| 0,625 % fällig am 22.02.2027 | | 2.000 | 2.424 | 0,25 |
| 0,750 % fällig am 15.01.2029 | | 2.400 | 2.941 | 0,30 |
| 5,000 % fällig am 19.03.2024 | AUD | 100 | 82 | 0,01 |
| **Landesbank Baden-Wuerttemberg** | | | | |
| 2,375 % fällig am 31.05.2022 | $ | 1.200 | 1.213 | 0,13 |
| **Landwirtschaftliche Rentenbank** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.01.2023 | AUD | 1.500 | 1.158 | 0,12 |
| 5,375 % fällig am 23.04.2024 | NZD | 1.100 | 860 | 0,09 |
| | | | 32.061 | 3,31 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Land Nordrhein-Westfalen** | | | | |
| 0,250 % fällig am 13.03.2026 | € | 5.600 | 6.575 | 0,68 |
| Summe Deutschland | | | 40.261 | 4,16 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 09.06.2023 | $ | 1.800 | 1.868 | 0,19 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | | 450 | 490 | 0,05 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | 2.358 | 0,24 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AIA Group Ltd.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 06.04.2028 | | 600 | 638 | 0,07 |
| **Eastern Creation Investment Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.09.2020 | | 1.000 | 1.001 | 0,10 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | | |
| 3,510 % fällig am 28.06.2021 | | 1.000 | 1.004 | 0,11 |
| **Poly Real Estate Finance Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 05.02.2023 | | 600 | 609 | 0,06 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 4,071 % fällig am 25.05.2023 | | 600 | 601 | 0,06 |
| Summe Hongkong | | | 3.853 | 0,40 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ICICI Bank Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 18.03.2020 | | 900 | 904 | 0,10 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,835 % fällig am 13.12.2027 | | 600 | 611 | 0,06 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,700 % fällig am 27.02.2022 | | 600 | 609 | 0,06 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.01.2022 (i) | | 600 | 614 | 0,06 |
| Summe Indien | | | 2.738 | 0,28 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Indonesia Asahan Aluminium Persero PT** | | | | |
| 5,230 % fällig am 15.11.2021 | | 500 | 527 | 0,06 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Black Diamond CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € | 2.000 | 2.280 | 0,24 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 2.400 | 2.734 | 0,28 |
| **Sorrento Park CLO DAC** | | | | |
| 0,639 % fällig am 16.11.2027 | | 1.257 | 1.433 | 0,15 |
| **Toro European CLO DAC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 15.10.2030 | | 2.500 | 2.854 | 0,29 |
| | | | 9.301 | 0,96 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 4,450 % fällig am 16.12.2021 | € | 200 | $ 208 | 0,02 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 200 | 205 | 0,02 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.10.2023 | | 400 | 421 | 0,04 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (f)(h) | | 400 | 482 | 0,05 |
| **GE Capital European Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.03.2023 | | 500 | 616 | 0,07 |
| **PartnerRe Ireland Finance DAC** | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.09.2026 | | 1.100 | 1.286 | 0,13 |
| **Shire Acquisitions Investments Ireland DAC** | | | | |
| 1,900 % fällig am 23.09.2019 | $ | 400 | 399 | 0,04 |
| 2,400 % fällig am 23.09.2021 | | 100 | 100 | 0,01 |
| | | | 3.717 | 0,38 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (g)** | | 4.450 | 508 | 0,05 |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (g)** | | 402.852 | 4.689 | 0,49 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Bluestep Mortgage Securities DAC** | | | | |
| 1,453 % fällig am 10.05.2063 | SEK | 3.723 | 403 | 0,04 |
| Summe Irland | | | 18.618 | 1,92 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banca Carige SpA** | | | | |
| 1,090 % fällig am 25.02.2021 | € | 3.400 | 3.888 | 0,40 |
| 1,389 % fällig am 25.10.2021 | | 1.000 | 1.152 | 0,12 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 2,000 % fällig am 29.01.2024 | | 2.200 | 2.588 | 0,27 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (f)(h) | | 800 | 963 | 0,10 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 2.300 | 2.629 | 0,27 |
| | | | 11.220 | 1,16 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,450 % fällig am 15.11.2024 (i) | € | 13.100 | 14.983 | 1,55 |
| 2,100 % fällig am 15.07.2026 | | 4.400 | 5.153 | 0,53 |
| 2,450 % fällig am 01.10.2023 (i) | | 2.250 | 2.702 | 0,28 |
| 2,450 % fällig am 01.09.2033 | | 300 | 346 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 15.11.2025 (i) | | 3.700 | 4.453 | 0,46 |
| 2,950 % fällig am 01.09.2038 | | 1.500 | 1.783 | 0,18 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2029 | | 5.800 | 7.165 | 0,74 |
| 3,450 % fällig am 01.03.2048 | | 400 | 502 | 0,05 |
| **Italy Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 | £ | 100 | 150 | 0,02 |
| | | | 37.237 | 3,85 |
| Summe Italien | | | 48.457 | 5,01 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 2,091 % fällig am 14.09.2021 | $ | 200 | 198 | 0,02 |
| 2,362 % fällig am 28.05.2021 | | 2.100 | 2.099 | 0,22 |
| 2,567 % fällig am 02.11.2021 | | 2.200 | 2.208 | 0,23 |
| 2,978 % fällig am 15.02.2022 | | 1.400 | 1.397 | 0,14 |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | | 800 | 801 | 0,08 |
| **Meiji Yasuda Life Insurance Co.** | | | | |
| 5,100 % fällig am 26.04.2048 | | 400 | 437 | 0,05 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.03.2021 | | 460 | 465 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,455 % fällig am 02.03.2023 | $ | 2.200 | $ 2.263 | 0,23 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,451 % fällig am 11.09.2024 | | 1.500 | 1.515 | 0,16 |
| 3,549 % fällig am 05.03.2023 | | 600 | 621 | 0,06 |
| 3,922 % fällig am 11.09.2024 | | 1.000 | 1.048 | 0,11 |
| **MUFG Bank Ltd.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 05.03.2020 | | 300 | 300 | 0,03 |
| **ORIX Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 04.12.2024 | | 400 | 413 | 0,04 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 0,550 % fällig am 06.11.2023 | € | 3.100 | 3.629 | 0,38 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 4,133 % fällig am 09.03.2021 | $ | 300 | 306 | 0,03 |
| | | | 17.700 | 1,83 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Development Bank of Japan, Inc.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 01.09.2021 | | 1.600 | 1.585 | 0,16 |
| **Japan Bank for International Cooperation** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.11.2022 | | 400 | 405 | 0,04 |
| 3,250 % fällig am 20.07.2023 | | 800 | 837 | 0,09 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 2,125 % fällig am 13.04.2021 | | 3.200 | 3.198 | 0,33 |
| 2,625 % fällig am 20.04.2022 | | 2.400 | 2.432 | 0,25 |
| 3,375 % fällig am 27.09.2023 | | 1.800 | 1.879 | 0,20 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (e) | ¥ | 777.646 | 7.539 | 0,78 |
| 0,100 % fällig am 20.03.2029 | | 3.620.000 | 34.479 | 3,57 |
| 0,500 % fällig am 20.09.2046 | | 1.451.000 | 14.057 | 1,45 |
| 0,500 % fällig am 20.03.2049 | | 966.000 | 9.315 | 0,96 |
| 0,700 % fällig am 20.12.2048 | | 1.718.000 | 17.460 | 1,81 |
| 1,400 % fällig am 20.09.2034 | | 6.120.000 | 68.233 | 7,06 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.05.2021 | $ | 1.200 | 1.196 | 0,12 |
| 2,500 % fällig am 08.06.2022 | | 4.500 | 4.547 | 0,47 |
| 2,625 % fällig am 29.05.2024 | | 400 | 409 | 0,04 |
| | | | 167.571 | 17,33 |
| Summe Japan | | | 185.271 | 19,16 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 200 | 233 | 0,02 |
| **KUWAIT** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kuwait International Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.03.2022 | $ | 200 | 203 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2027 | | 6.700 | 7.143 | 0,74 |
| Summe Kuwait | | | 7.346 | 0,76 |
| **LITAUEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Lithuania Government International Bond** | | | | |
| 6,125 % fällig am 09.03.2021 | | 1.500 | 1.594 | 0,17 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | |
| 0,012 % fällig am 20.05.2024 | € | 247 | 282 | 0,03 |
| 0,024 % fällig am 15.07.2026 | | 2.200 | 2.506 | 0,26 |
| **Red & Black Auto Lease Germany S.A.** | | | | |
| 0,024 % fällig am 15.11.2027 | | 949 | 1.081 | 0,11 |
| **Silver Arrow S.A.** | | | | |
| 0,074 % fällig am 17.03.2025 | | 635 | 725 | 0,07 |
| | | | 4.594 | 0,47 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Allergan Funding SCS** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.11.2023 | | 100 | 119 | 0,01 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.11.2026 | | 700 | 839 | 0,09 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | | 700 | 843 | 0,09 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **CPI Property Group S.A.** | | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | € | 2.200 | $ | 2.544 | 0,26 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (d) | | 1.400 | | 1.545 | 0,16 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | | |
| 0,200 % fällig am 17.01.2024 | | 3.000 | | 3.511 | 0,36 |
| 1,250 % fällig am 24.05.2033 | | 4.100 | | 5.234 | 0,54 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | | 1.300 | | 1.532 | 0,16 |
| **NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 16.02.2021 | $ | 1.600 | | 1.618 | 0,17 |
| | | | | 17.785 | 1,84 |
| Summe Luxemburg | | | | 22.379 | 2,31 |
| **MULTINATIONAL** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Preferred Term Securities Ltd.** | | | | | |
| 2,810 % fällig am 23.06.2035 | | 1.508 | | 1.448 | 0,15 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Accunia European CLO BV** | | | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € | 800 | | 913 | 0,10 |
| **Cairn CLO BV** | | | | | |
| 0,930 % fällig am 30.04.2031 | | 2.200 | | 2.515 | 0,26 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | | 500 | | 568 | 0,06 |
| 0,530 % fällig am 12.07.2028 | | 1.700 | | 1.936 | 0,20 |
| | | | | 5.932 | 0,62 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (f)(h) | | 600 | | 712 | 0,07 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (f)(h) | | 200 | | 253 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 (h) | | 3.100 | | 3.706 | 0,38 |
| **Enel Finance International NV** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 06.04.2028 | $ | 1.100 | | 1.085 | 0,11 |
| **ING Bank NV** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | | 6.800 | | 6.937 | 0,72 |
| **JT International Financial Services BV** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 28.09.2033 | £ | 700 | | 920 | 0,09 |
| **Mylan NV** | | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.06.2021 | $ | 400 | | 400 | 0,04 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 500 | | 590 | 0,06 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (f) | | 353 | | 493 | 0,05 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | | |
| 1,700 % fällig am 19.07.2019 | $ | 776 | | 774 | 0,08 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 07.09.2021 | £ | 800 | | 1.023 | 0,11 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 02.10.2023 | € | 1.800 | | 2.092 | 0,22 |
| 1,239 % fällig am 16.11.2024 | | 3.900 | | 4.535 | 0,47 |
| | | | | 23.520 | 2,43 |
| Summe Niederlande | | | | 29.452 | 3,05 |
| **NORWEGEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **DNB Boligkreditt A/S** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 28.03.2022 | $ | 4.000 | | 4.051 | 0,42 |
| **Sparebanken Soer Boligkreditt A/S** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 22.03.2021 | € | 100 | | 115 | 0,01 |
| | | | | 4.166 | 0,43 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Kommunalbanken A/S** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 12.04.2021 | AUD | 2.700 | | 2.067 | 0,21 |
| **Norway Government International Bond** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 13.03.2025 | NOK | 6.300 | | 758 | 0,08 |
| 3,750 % fällig am 25.05.2021 | | 3.700 | | 454 | 0,05 |
| | | | | 3.279 | 0,34 |
| Summe Norwegen | | | | 7.445 | 0,77 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **PERU** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 7.800 | $ | 2.589 | 0,27 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 2.000 | | 669 | 0,07 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 7.900 | | 2.699 | 0,28 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 2.900 | | 1.035 | 0,10 |
| Summe Peru | | | | 6.992 | 0,72 |
| **POLEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Poland Government International Bond** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 25.07.2025 | PLN | 1.650 | | 471 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 25.10.2023 | | 10.300 | | 2.999 | 0,31 |
| Summe Polen | | | | 3.470 | 0,36 |
| **PORTUGAL** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.01.2019 ^ | € | 400 | | 112 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | | 700 | | 195 | 0,02 |
| Summe Portugal | | | | 307 | 0,03 |
| **KATAR** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.03.2024 | $ | 4.800 | | 4.966 | 0,51 |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | | 600 | | 630 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 14.03.2029 | | 3.700 | | 3.994 | 0,41 |
| 4,500 % fällig am 20.01.2022 | | 500 | | 526 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 23.04.2028 | | 1.900 | | 2.129 | 0,22 |
| Summe Katar | | | | 12.245 | 1,27 |
| **RUSSLAND** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 10.05.2034 | RUB | 177.300 | | 2.775 | 0,29 |
| 7,650 % fällig am 10.04.2030 | | 120.600 | | 1.961 | 0,20 |
| 7,950 % fällig am 07.10.2026 | | 280.700 | | 4.619 | 0,48 |
| Summe Russland | | | | 9.355 | 0,97 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Saudi Government International Bond** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 26.10.2021 | $ | 8.000 | | 7.996 | 0,83 |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 500 | | 507 | 0,05 |
| 3,250 % fällig am 26.10.2026 | | 700 | | 715 | 0,07 |
| 3,625 % fällig am 04.03.2028 | | 500 | | 514 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 6.100 | | 6.502 | 0,67 |
| 4,375 % fällig am 16.04.2029 | | 2.100 | | 2.274 | 0,24 |
| Summe Saudi-Arabien | | | | 18.508 | 1,91 |
| **SINGAPUR** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 200 | | 200 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 18.09.2027 | | 500 | | 498 | 0,05 |
| **DBS Bank Ltd.** | | | | | |
| 3,300 % fällig am 27.11.2021 | | 900 | | 922 | 0,10 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | | | |
| 2,975 % fällig am 17.05.2021 | | 1.200 | | 1.201 | 0,12 |
| Summe Singapur | | | | 2.821 | 0,29 |
| **SLOWENIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | | |
| 1,188 % fällig am 14.03.2029 | € | 1.400 | | 1.750 | 0,18 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 1.748 | | 1.968 | 0,21 |
| Summe Slowenien | | | | 3.718 | 0,39 |
| **SÜDKOREA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 25.07.2023 | | 400 | | 418 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Korea Government International Bond** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 10.06.2027 | KRW | 2.095.000 | $ | 1.887 | 0,20 |
| 2,375 % fällig am 10.12.2028 | | 4.190.000 | | 3.879 | 0,40 |
| 2,625 % fällig am 10.06.2028 | | 4.190.000 | | 3.942 | 0,41 |
| Summe Südkorea | | | | 10.126 | 1,05 |
| **SPANIEN** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Driver Espana ET** | | | | | |
| 0,011 % fällig am 21.04.2028 | € | 709 | | 810 | 0,08 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h) | | 200 | | 236 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (f)(h) | | 1.000 | | 1.198 | 0,12 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (f)(h) | | 800 | | 938 | 0,10 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | | |
| 3,848 % fällig am 12.04.2023 | $ | 400 | | 416 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 19.03.2025 (f)(h) | € | 3.000 | | 3.237 | 0,34 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (f)(h) | | 500 | | 600 | 0,06 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | | 900 | | 1.071 | 0,11 |
| **Merlin Properties Socimi S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 26.05.2025 | | 1.600 | | 1.910 | 0,20 |
| | | | | 9.606 | 0,99 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Autonomous Community of Andalusia** | | | | | |
| 4,850 % fällig am 17.03.2020 | | 600 | | 708 | 0,07 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | | |
| 4,220 % fällig am 26.04.2035 | | 400 | | 548 | 0,06 |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | | 1.400 | | 1.725 | 0,18 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 2.700 | | 3.162 | 0,33 |
| **Spain Government International Bond** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 30.07.2024 | | 3.800 | | 4.419 | 0,46 |
| 0,600 % fällig am 31.10.2029 (i) | | 7.400 | | 8.557 | 0,89 |
| 1,400 % fällig am 30.07.2028 (i) | | 12.300 | | 15.366 | 1,59 |
| 2,700 % fällig am 31.10.2048 | | 600 | | 899 | 0,09 |
| 2,900 % fällig am 31.10.2046 (i) | | 2.700 | | 4.182 | 0,43 |
| 5,250 % fällig am 06.04.2029 | £ | 500 | | 793 | 0,08 |
| | | | | 40.359 | 4,18 |
| Summe Spanien | | | | 50.775 | 5,25 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 21.12.2023 | AUD | 3.100 | | 2.062 | 0,21 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | | |
| 0,050 % fällig am 24.05.2024 | € | 3.800 | | 4.431 | 0,46 |
| 0,500 % fällig am 21.07.2023 | AUD | 1.200 | | 807 | 0,08 |
| 0,625 % fällig am 22.01.2029 | € | 600 | | 726 | 0,08 |
| **Nordic Investment Bank** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 19.04.2022 | AUD | 900 | | 695 | 0,07 |
| Summe übernational | | | | 8.721 | 0,90 |
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Danske Hypotek AB** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 21.12.2022 | SEK | 18.000 | | 2.005 | 0,21 |
| **Landshypotek Bank AB** | | | | | |
| 0,700 % fällig am 09.05.2022 | | 38.000 | | 4.171 | 0,43 |
| **Stadshypotek AB** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.12.2021 | | 33.000 | | 3.695 | 0,38 |
| 2,500 % fällig am 05.04.2022 | $ | 3.000 | | 3.031 | 0,31 |
| **Sveriges Sakerstallda Obligationer AB** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 15.06.2022 | SEK | 22.000 | | 2.461 | 0,26 |
| 2,000 % fällig am 17.06.2026 | | 14.000 | | 1.662 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Swedbank Hypotek AB** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.09.2021 | SEK | 56.300 | $ 6.216 | 0,64 |
| Summe Schweden | | | 23.241 | 2,40 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 0,750 % fällig am 17.09.2021 | € | 400 | 467 | 0,05 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2021 | | 1.300 | 1.529 | 0,16 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,628 % fällig am 14.12.2023 | $ | 3.400 | 3.409 | 0,35 |
| **UBS AG** | | | | |
| 2,200 % fällig am 08.06.2020 | | 1.900 | 1.899 | 0,20 |
| 3,000 % fällig am 01.12.2020 | | 700 | 702 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h) | | 600 | 638 | 0,07 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | | 3.750 | 4.208 | 0,43 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 2,950 % fällig am 24.09.2020 | | 1.700 | 1.712 | 0,18 |
| | | | 14.564 | 1,51 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Switzerland Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 08.04.2033 | CHF | 3.200 | 5.038 | 0,52 |
| Summe Schweiz | | | 19.602 | 2,03 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.03.2022 | $ | 1.200 | 1.213 | 0,12 |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 1.500 | 1.509 | 0,16 |
| | | | 2.722 | 0,28 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | | 2.000 | 2.018 | 0,21 |
| 3,125 % fällig am 11.10.2027 | | 1.700 | 1.767 | 0,18 |
| | | | 3.785 | 0,39 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | 6.507 | 0,67 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | |
| 1,310 % fällig am 20.09.2028 | £ | 1.900 | 2.422 | 0,25 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | $ | 6.390 | 6.982 | 0,72 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | £ | 1.800 | 2.294 | 0,24 |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | $ | 3.100 | 3.209 | 0,33 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | € | 700 | 807 | 0,08 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | £ | 300 | 386 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (f)(h) | | 300 | 399 | 0,04 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (f)(h) | € | 600 | 740 | 0,08 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (f)(h) | $ | 800 | 840 | 0,09 |
| **Diageo Finance PLC** | | | | |
| 0,250 % fällig am 22.10.2021 | € | 2.200 | 2.529 | 0,26 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 0,869 % fällig am 13.09.2021 | | 600 | 686 | 0,07 |
| 1,660 % fällig am 11.02.2021 | | 500 | 581 | 0,06 |
| **Frontier Finance PLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 23.03.2022 | £ | 2.800 | 3.723 | 0,39 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,120 % fällig am 18.05.2021 | $ | 1.200 | 1.201 | 0,12 |
| 3,520 % fällig am 18.05.2024 | | 1.000 | 1.003 | 0,10 |
| 3,950 % fällig am 18.05.2024 | | 400 | 419 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 04.07.2029 (f)(h) | € | 900 | 1.079 | 0,11 |
| 6,500 % fällig am 23.03.2028 (f)(h) | $ | 600 | 629 | 0,07 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 3,300 % fällig am 07.05.2021 | | 500 | 508 | 0,05 |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | £ | 1.100 | 1.745 | 0,18 |
| 6,500 % fällig am 24.03.2020 | € | 1.700 | 2.026 | 0,21 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (f)(h) | £ | 300 | 417 | 0,04 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | $ | 2.100 | 2.145 | 0,22 |
| **RAC Bond Co. PLC** | | | | |
| 4,565 % fällig am 06.05.2046 | £ | 1.400 | $ 1.775 | 0,18 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.06.2022 | $ | 1.100 | 1.099 | 0,11 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | € | 2.100 | 2.542 | 0,26 |
| 3,498 % fällig am 15.05.2023 | $ | 1.900 | 1.922 | 0,20 |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | | 500 | 513 | 0,05 |
| 3,988 % fällig am 15.05.2023 | | 1.900 | 1.895 | 0,20 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 2.100 | 2.173 | 0,23 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (f)(h) | | 500 | 514 | 0,05 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | | 2.500 | 2.526 | 0,26 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (f)(h) | £ | 473 | 641 | 0,07 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.03.2020 | $ | 200 | 200 | 0,02 |
| 4,250 % fällig am 12.04.2021 | € | 500 | 617 | 0,06 |
| **Tesco PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | £ | 137 | 195 | 0,02 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 1.308 | 2.177 | 0,23 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | | 1.300 | 1.708 | 0,18 |
| **Virgin Money PLC** | | | | |
| 1,417 % fällig am 22.03.2024 | | 1.100 | 1.409 | 0,15 |
| 2,250 % fällig am 21.04.2020 | | 1.575 | 2.020 | 0,21 |
| | | | 58.274 | 6,02 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Aggregator of Loans Backed by Assets PLC** | | | | |
| 1,972 % fällig am 24.04.2049 | | 1.210 | 1.545 | 0,16 |
| **Business Mortgage Finance PLC** | | | | |
| 0,069 % fällig am 15.08.2040 | € | 405 | 457 | 0,05 |
| **Dukinfield PLC** | | | | |
| 1,806 % fällig am 15.08.2045 | £ | 1.123 | 1.433 | 0,15 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,946 % fällig am 10.06.2044 | | 130 | 164 | 0,02 |
| 1,739 % fällig am 13.06.2045 | | 1.209 | 1.528 | 0,16 |
| **Feldspar PLC** | | | | |
| 1,486 % fällig am 15.09.2045 | | 504 | 643 | 0,07 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,473 % fällig am 12.09.2065 | | 1.536 | 1.954 | 0,20 |
| 1,743 % fällig am 12.09.2068 | | 3.870 | 4.940 | 0,51 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | |
| 2,195 % fällig am 25.05.2053 | | 1.227 | 1.565 | 0,16 |
| **Lanark Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,619 % fällig am 22.12.2069 | | 1.900 | 2.427 | 0,25 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 1,436 % fällig am 15.12.2049 | | 895 | 1.112 | 0,11 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 0,282 % fällig am 15.12.2050 | € | 702 | 774 | 0,08 |
| **Oncilla Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 2,193 % fällig am 12.12.2043 | £ | 1.731 | 2.220 | 0,23 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,061 % fällig am 15.01.2039 | | 2.040 | 2.464 | 0,25 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,582 % fällig am 20.03.2050 | | 2.635 | 3.349 | 0,34 |
| 1,936 % fällig am 15.06.2046 | | 241 | 307 | 0,03 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | | 4.766 | 6.059 | 0,63 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,493 % fällig am 12.06.2046 | | 1.465 | 1.847 | 0,19 |
| 1,763 % fällig am 12.06.2046 | | 1.745 | 2.219 | 0,23 |
| **Rochester Financing PLC** | | | | |
| 2,081 % fällig am 18.06.2045 | | 1.643 | 2.102 | 0,22 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 3.000 | 3.833 | 0,40 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 0,986 % fällig am 10.06.2059 | | 381 | 464 | 0,05 |
| 1,136 % fällig am 10.06.2059 | | 93 | 111 | 0,01 |
| 1,336 % fällig am 10.06.2059 | | 73 | 88 | 0,01 |
| 1,536 % fällig am 10.06.2059 | | 77 | 92 | 0,01 |
| | | | 43.697 | 4,52 |
| **AKTIEN** | | | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % | | 1.870 | 360 | 0,04 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 2.200 | $ 3.824 | 0,40 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2040 (i) | | 1.700 | 3.301 | 0,34 |
| | | | 7.125 | 0,74 |
| Summe Großbritannien | | | 111.878 | 11,57 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | |
| 3,104 % fällig am 25.10.2031 | $ | 4 | 4 | 0,00 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 3,104 % fällig am 25.06.2034 | | 154 | 154 | 0,02 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.04.2031 | | 27 | 40 | 0,00 |
| 2,814 % fällig am 25.02.2036 | | 4.374 | 4.742 | 0,49 |
| 3,404 % fällig am 25.10.2037 | | 305 | 307 | 0,03 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.12.2036 | | 284 | 193 | 0,02 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.06.2037 | | 2.087 | 1.979 | 0,21 |
| 2,544 % fällig am 25.07.2037 | | 618 | 564 | 0,06 |
| 2,744 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 16 | 10 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 3,024 % fällig am 25.01.2032 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Home Equity Mortgage Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 279 | 138 | 0,01 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.05.2036 | | 1.593 | 1.065 | 0,11 |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 3,530 % fällig am 25.04.2038 | | 222 | 224 | 0,02 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.10.2036 | | 2.075 | 1.953 | 0,20 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,484 % fällig am 25.09.2037 | | 7 | 4 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.02.2037 | | 3.659 | 1.589 | 0,16 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,504 % fällig am 25.11.2036 | | 1.590 | 1.139 | 0,12 |
| 2,529 % fällig am 25.07.2036 | | 159 | 140 | 0,02 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,700 % fällig am 20.06.2031 | | 424 | 429 | 0,05 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 | | 813 | 612 | 0,06 |
| 2,544 % fällig am 25.02.2037 | | 2.936 | 2.156 | 0,22 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,404 % fällig am 25.12.2033 | | 15 | 15 | 0,00 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 2,964 % fällig am 25.06.2032 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,844 % fällig am 25.11.2035 | | 500 | 502 | 0,05 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 2,550 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 16 | 5 | 0,00 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | |
| 3,396 % fällig am 25.11.2042 | | 1.199 | 1.205 | 0,13 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | | 878 | 879 | 0,09 |
| 2,654 % fällig am 25.11.2036 | | 2.700 | 2.546 | 0,26 |
| 2,674 % fällig am 25.12.2036 | | 3.000 | 2.851 | 0,30 |
| 2,874 % fällig am 25.11.2035 | | 700 | 694 | 0,07 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,940 % fällig am 25.04.2035 | | 98 | 97 | 0,01 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | | 1.421 | 1.428 | 0,15 |
| | | | 27.672 | 2,86 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.11.2021 | | 3.700 | 3.764 | 0,39 |
| **Allergan, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.09.2020 | | 300 | 303 | 0,03 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 500 | 501 | 0,05 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 200 | 203 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2020 | | 200 | 208 | 0,02 |
| **American Honda Finance Corp.** | | | | |
| 2,915 % fällig am 05.11.2021 | | 400 | 401 | 0,04 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.01.2025 | $ | 1.400 | $ 1.412 | 0,15 |
| 3,450 % fällig am 15.09.2021 | | 800 | 818 | 0,09 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 1,800 % fällig am 05.09.2026 | € | 2.000 | 2.469 | 0,26 |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | $ | 3.200 | 3.217 | 0,33 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 2.200 | 2.220 | 0,23 |
| 3,616 % fällig am 12.06.2024 | | 2.800 | 2.837 | 0,29 |
| **AutoNation, Inc.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.01.2021 | | 100 | 101 | 0,01 |
| **AXA Equitable Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 20.04.2023 | | 100 | 104 | 0,01 |
| 4,350 % fällig am 20.04.2028 | | 100 | 105 | 0,01 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | | 600 | 602 | 0,06 |
| 3,398 % fällig am 15.08.2022 | | 1.900 | 1.906 | 0,20 |
| **Baxalta, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 23.06.2020 | | 90 | 90 | 0,01 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,979 % fällig am 25.06.2021 | | 500 | 497 | 0,05 |
| 3,420 % fällig am 15.12.2023 | | 900 | 884 | 0,09 |
| 3,875 % fällig am 15.12.2023 | | 500 | 520 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 15.12.2025 | | 900 | 953 | 0,10 |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028 | | 900 | 950 | 0,10 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.03.2021 | | 700 | 709 | 0,07 |
| 3,650 % fällig am 15.03.2023 | | 1.300 | 1.339 | 0,14 |
| **CenterPoint Energy Resources Corp.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.04.2023 | | 300 | 309 | 0,03 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 300 | 303 | 0,03 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2028 | | 1.100 | 1.109 | 0,12 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 700 | 736 | 0,08 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 (b) | | 1.200 | 1.230 | 0,13 |
| **Citizens Bank N.A.** | | | | |
| 3,091 % fällig am 26.05.2020 | | 2.300 | 2.306 | 0,24 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 09.03.2021 | | 300 | 304 | 0,03 |
| 3,700 % fällig am 09.03.2023 | | 700 | 724 | 0,08 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 500 | 515 | 0,05 |
| **Discover Bank** | | | | |
| 3,350 % fällig am 06.02.2023 | | 500 | 512 | 0,05 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 3,097 % fällig am 20.09.2019 | | 700 | 701 | 0,07 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | | 1.800 | 1.809 | 0,19 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 300 | 298 | 0,03 |
| **Equifax, Inc.** | | | | |
| 3,388 % fällig am 15.08.2021 | | 400 | 399 | 0,04 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.05.2023 | € | 600 | 697 | 0,07 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | | 650 | 725 | 0,08 |
| 0,100 % fällig am 07.12.2022 | | 200 | 219 | 0,02 |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | | 200 | 225 | 0,02 |
| 2,425 % fällig am 12.06.2020 | $ | 300 | 299 | 0,03 |
| 2,459 % fällig am 27.03.2020 | | 400 | 399 | 0,04 |
| 2,597 % fällig am 04.11.2019 | | 200 | 200 | 0,02 |
| 3,157 % fällig am 04.08.2020 | | 2.000 | 2.008 | 0,21 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 26.05.2023 | € | 300 | 353 | 0,04 |
| **General Mills, Inc.** | | | | |
| 3,141 % fällig am 16.04.2021 | $ | 200 | 200 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 100 | 106 | 0,01 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 0,207 % fällig am 26.03.2022 | € | 100 | 112 | 0,01 |
| 3,442 % fällig am 09.04.2021 | $ | 200 | 200 | 0,02 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,752 % fällig am 23.04.2020 | | 1.600 | 1.610 | 0,17 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 2,926 % fällig am 26.04.2021 | | 900 | 901 | 0,09 |
| 3,086 % fällig am 26.04.2021 | | 1.400 | 1.408 | 0,15 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.12.2024 | | 200 | 206 | 0,02 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.11.2009 ^ | $ | 700 | $ 12 | 0,00 |
| 5,625 % fällig am 24.01.2013 ^ | | 600 | 11 | 0,00 |
| 6,200 % fällig am 26.09.2014 ^ | | 1.400 | 25 | 0,00 |
| 7,875 % fällig am 08.05.2018 ^ | £ | 1.800 | 57 | 0,01 |
| **McDonald's Corp.** | | | | |
| 3,012 % fällig am 28.10.2021 | $ | 1.300 | 1.301 | 0,14 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 500 | 519 | 0,05 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | | 1.900 | 1.901 | 0,20 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 2,930 % fällig am 15.03.2021 | | 400 | 399 | 0,04 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | | 300 | 326 | 0,03 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 10.03.2025 | | 2.500 | 2.626 | 0,27 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 200 | 208 | 0,02 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | | 900 | 914 | 0,10 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 1.200 | 1.195 | 0,12 |
| **Southern Power Co.** | | | | |
| 2,937 % fällig am 20.12.2020 | | 1.200 | 1.200 | 0,13 |
| **Spectra Energy Partners LP** | | | | |
| 3,179 % fällig am 05.06.2020 | | 300 | 301 | 0,03 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 3,210 % fällig am 15.06.2021 | | 200 | 199 | 0,02 |
| 3,950 % fällig am 15.06.2023 | | 300 | 310 | 0,03 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | | 500 | 520 | 0,06 |
| **United Technologies Corp.** | | | | |
| 3,175 % fällig am 16.08.2021 | | 500 | 500 | 0,05 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.08.2026 | | 700 | 696 | 0,07 |
| 3,618 % fällig am 15.05.2025 | | 1.900 | 1.926 | 0,20 |
| 4,125 % fällig am 16.03.2027 | | 900 | 980 | 0,10 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 3,305 % fällig am 13.11.2020 | | 800 | 804 | 0,08 |
| 3,475 % fällig am 12.11.2021 | | 800 | 807 | 0,08 |
| 3,875 % fällig am 13.11.2020 | | 600 | 613 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 12.11.2021 | | 600 | 620 | 0,07 |
| **WEA Finance LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 17.09.2024 | | 1.400 | 1.462 | 0,15 |
| **WRKCo, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.03.2025 | | 500 | 519 | 0,05 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | | 1.900 | 1.930 | 0,20 |
| | | | 71.117 | 7,36 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **CenturyLink, Inc.** | | | | |
| 5,152 % fällig am 31.01.2025 | | 1.084 | 1.060 | 0,11 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 4,446 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 34 | 33 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.05.2046 ^ | | 389 | 366 | 0,04 |
| 3,444 % fällig am 25.10.2046 | | 1.348 | 1.215 | 0,13 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 2,543 % fällig am 20.02.2047 | | 1.715 | 1.672 | 0,17 |
| 4,492 % fällig am 20.10.2046 ^ | | 150 | 121 | 0,01 |
| 4,648 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 95 | 93 | 0,01 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.10.2031 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 3,443 % fällig am 25.05.2034 | | 23 | 21 | 0,00 |
| 4,345 % fällig am 25.08.2033 | | 13 | 13 | 0,00 |
| 4,392 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 317 | 300 | 0,03 |
| 4,607 % fällig am 25.10.2033 | | 21 | 22 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 3,987 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 551 | 462 | 0,05 |
| 4,159 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 225 | 198 | 0,02 |
| 4,294 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 437 | 369 | 0,04 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 3,801 % fällig am 26.12.2046 ^ | $ | 723 | $ 627 | 0,07 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 3,799 % fällig am 25.07.2037 | | 90 | 82 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,291 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 576 | 562 | 0,06 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 4,433 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 737 | 684 | 0,07 |
| 4,550 % fällig am 25.09.2035 | | 76 | 78 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 4,243 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 840 | 787 | 0,08 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.02.2037 | | 3.853 | 3.196 | 0,33 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,563 % fällig am 20.02.2047 ^ | | 1.385 | 1.100 | 0,11 |
| 2,593 % fällig am 20.07.2046 ^ | | 338 | 267 | 0,03 |
| 2,754 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 97 | 50 | 0,01 |
| 3,174 % fällig am 25.11.2035 | | 216 | 212 | 0,02 |
| 4,004 % fällig am 25.11.2035 | | 106 | 98 | 0,01 |
| 4,419 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 259 | 254 | 0,03 |
| 4,544 % fällig am 25.11.2035 | | 42 | 41 | 0,01 |
| 4,554 % fällig am 20.10.2035 | | 1.896 | 1.660 | 0,17 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 35 | 34 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 2.743 | 1.958 | 0,20 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 75 | 63 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 218 | 167 | 0,02 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,864 % fällig am 25.05.2035 | | 37 | 35 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | | 186 | 177 | 0,02 |
| 3,064 % fällig am 25.02.2035 | | 92 | 92 | 0,01 |
| 3,164 % fällig am 25.09.2034 | | 11 | 12 | 0,00 |
| 3,927 % fällig am 25.08.2034 ^ | | 12 | 12 | 0,00 |
| 4,178 % fällig am 25.08.2034 ^ | | 13 | 13 | 0,00 |
| 4,280 % fällig am 25.11.2034 | | 11 | 11 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 | | 1.810 | 1.615 | 0,17 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 2,744 % fällig am 25.06.2035 | | 233 | 225 | 0,02 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 793 | 751 | 0,08 |
| **Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,504 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 8 | 6 | 0,00 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,650 % fällig am 19.08.2045 | | 110 | 107 | 0,01 |
| 2,710 % fällig am 19.07.2045 ^ | | 9 | 1 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,518 % fällig am 25.08.2035 | | 31 | 26 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,944 % fällig am 25.11.2045 | | 24 | 21 | 0,00 |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,111 % fällig am 10.11.2045 (a) | | 2.572 | 141 | 0,02 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,300 % fällig am 25.03.2033 | | 20 | 20 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,354 % fällig am 19.12.2036 ^ | | 248 | 244 | 0,03 |
| 4,504 % fällig am 19.10.2035 | | 600 | 466 | 0,05 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 3,404 % fällig am 25.07.2033 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,422 % fällig am 25.03.2036 | | 941 | 878 | 0,09 |
| 4,290 % fällig am 25.12.2034 | | 17 | 17 | 0,00 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.10.2036 | | 523 | 513 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 2 | 1 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | |
| 3,722 % fällig am 27.07.2037 | | 386 | 395 | 0,04 |
| 4,304 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 179 | 150 | 0,02 |
| 4,323 % fällig am 25.11.2033 | | 10 | 11 | 0,00 |
| **MASTR Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 89 | 17 | 0,00 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,834 % fällig am 15.12.2030 | | 34 | 33 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.03.2037 | | 7.570 | 3.166 | 0,33 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 645 | 569 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| 2,554 % fällig am 25.02.2047 | $ 245 | $ 142 | 0,02 |
| 2,564 % fällig am 25.03.2047 | 1.510 | 1.463 | 0,15 |
| 2,584 % fällig am 25.07.2036 ^ | 1.579 | 999 | 0,10 |
| 2,584 % fällig am 25.06.2046 | 962 | 387 | 0,04 |
| 3,204 % fällig am 25.10.2045 | 124 | 114 | 0,01 |
| 3,752 % fällig am 25.11.2037 | 1.327 | 1.235 | 0,13 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 6,628 % fällig am 25.05.2036 | 648 | 437 | 0,05 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | |
| 4,485 % fällig am 25.09.2035 ^ | 58 | 48 | 0,01 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,733 % fällig am 20.07.2033 | 33 | 33 | 0,00 |
| 4,044 % fällig am 20.07.2037 | 1.118 | 1.059 | 0,11 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,427 % fällig am 25.09.2034 | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,566 % fällig am 25.02.2034 | 35 | 35 | 0,00 |
| 4,714 % fällig am 25.04.2034 | 59 | 61 | 0,01 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | 2.784 | 2.668 | 0,28 |
| 2,594 % fällig am 25.07.2046 ^ | 556 | 482 | 0,05 |
| 2,614 % fällig am 25.05.2036 | 331 | 312 | 0,03 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2036 | 1.240 | 1.171 | 0,12 |
| 2,664 % fällig am 25.05.2046 ^ | 6 | 10 | 0,00 |
| 2,970 % fällig am 19.07.2034 | 13 | 13 | 0,00 |
| 3,090 % fällig am 19.03.2034 | 6 | 6 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | |
| 2,684 % fällig am 25.01.2036 | 230 | 213 | 0,02 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,694 % fällig am 25.10.2036 | 679 | 604 | 0,06 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 3,452 % fällig am 25.06.2047 ^ | 199 | 187 | 0,02 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.01.2037 | 2.506 | 1.662 | 0,17 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,345 % fällig am 27.02.2034 | 17 | 17 | 0,00 |
| 2,714 % fällig am 25.01.2045 | 49 | 49 | 0,01 |
| 3,504 % fällig am 25.02.2046 | 417 | 426 | 0,04 |
| 3,696 % fällig am 25.06.2037 ^ | 200 | 188 | 0,02 |
| 3,957 % fällig am 25.02.2037 ^ | 1.785 | 1.780 | 0,18 |
| 3,981 % fällig am 25.05.2037 ^ | 961 | 939 | 0,10 |
| 3,998 % fällig am 25.09.2036 | 275 | 268 | 0,03 |
| 4,814 % fällig am 25.03.2034 | 3 | 3 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 3,444 % fällig am 25.07.2046 ^ | 115 | 85 | 0,01 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,856 % fällig am 25.09.2034 | $ 21 | $ 22 | 0,00 |
| | | 43.656 | 4,52 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.03.2034 | 13 | 13 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.08.2034 | 14 | 14 | 0,00 |
| 2,560 % fällig am 25.03.2036 | 13 | 13 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.06.2036 | 54 | 54 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.10.2040 | 98 | 99 | 0,01 |
| 2,944 % fällig am 25.07.2039 | 2.312 | 2.381 | 0,25 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2021 | 859 | 884 | 0,09 |
| 3,682 % fällig am 01.09.2044 | 85 | 86 | 0,01 |
| 4,034 % fällig am 01.10.2034 | 7 | 7 | 0,00 |
| 4,291 % fällig am 01.12.2034 | 18 | 19 | 0,00 |
| 4,295 % fällig am 01.06.2021 | 910 | 946 | 0,10 |
| 4,743 % fällig am 01.11.2034 | 116 | 123 | 0,01 |
| 5,270 % fällig am 01.01.2036 | 27 | 28 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2043 - 25.07.2044 | 152 | 174 | 0,02 |
| 7,000 % fällig am 01.08.2037 | 34 | 35 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.04.2043 | 131 | 133 | 0,01 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2034 - 01.08.2049 | 129.100 | 131.982 | 13,65 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 50.800 | 52.492 | 5,43 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 1,854 % fällig am 15.01.2038 (a) | 781 | 51 | 0,01 |
| 2,859 % fällig am 15.01.2038 | 781 | 777 | 0,08 |
| 2,994 % fällig am 15.12.2037 | 43 | 44 | 0,00 |
| 3,084 % fällig am 15.07.2040 | 277 | 279 | 0,03 |
| 3,404 % fällig am 25.05.2043 | 29 | 29 | 0,00 |
| 3,488 % fällig am 25.02.2045 | 102 | 102 | 0,01 |
| 3,704 % fällig am 25.10.2044 | 274 | 277 | 0,03 |
| 4,521 % fällig am 01.09.2035 | 6 | 7 | 0,00 |
| **Freddie Mac, TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 100 | 103 | 0,01 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 4,125 % fällig am 20.11.2022 | 3 | 3 | 0,00 |
| **NCUA Guaranteed Notes** | | | |
| 2,889 % fällig am 05.11.2020 | 933 | 934 | 0,10 |
| 2,979 % fällig am 08.12.2020 | 1.115 | 1.118 | 0,12 |
| | | 193.207 | 19,98 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.01.2022 | $ 790 | $ 785 | 0,08 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 (i) | 5.148 | 5.109 | 0,53 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 (i) | 1.832 | 1.852 | 0,19 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 (i) | 12.637 | 12.848 | 1,33 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | 215 | 220 | 0,02 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 (i) | 8.911 | 9.383 | 0,97 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 (j) | 1.316 | 1.495 | 0,15 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | 488 | 547 | 0,06 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 579 | 645 | 0,07 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 | 68 | 76 | 0,01 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2027 | 633 | 732 | 0,07 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 (i) | 2.380 | 2.865 | 0,30 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 (i) | 1.399 | 1.874 | 0,19 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 (i) | 2.900 | 2.928 | 0,30 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 (i) | 2.300 | 2.356 | 0,25 |
| 2,875 % fällig am 30.04.2025 (i) | 19.400 | 20.535 | 2,12 |
| **U.S. Treasury STRIPS** | | | |
| 0,000 % fällig am 15.11.2023 (d) | 300 | 278 | 0,03 |
| | | 64.528 | 6,67 |
| Summe USA | | 401.240 | 41,50 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (k)** | | | |
| | | 2.304 | 0,24 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 2.304 | 0,24 |
| **AKTIEN** | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | 452.160 | 4.529 | 0,47 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 1.253.203** | **129,60** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 348 | $ 48 | 0,01 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 20 | 9 | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 129 | 266 | 0,03 |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09/2019 | 206 | 159 | 0,02 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2019 | 25 | (151) | (0,02) |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 54 | 340 | 0,03 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 366 | (1.401) | (0,15) |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09/2019 | 415 | 76 | 0,01 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 575 | 957 | 0,10 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 742 | 1.361 | 0,14 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 6 | 54 | 0,01 |
| United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate September Futures | Long | 09/2019 | 1.290 | 742 | 0,08 |
| United Kingdom 90-Day LIBOR Sterling Interest Rate September Futures | Short | 09/2020 | 1.290 | (1.345) | (0,14) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 50 | 8 | 0,00 |
| | | | | $ 1.123 | 0,12 |

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | $ 114,000 | 23.08.2019 | 245 | $ 2 | $ 0 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 127,000 | 26.07.2019 | 64 | $ (26) | $ (78) | (0,01) |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 125,500 | 26.07.2019 | 126 | (42) | (6) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 126 | (44) | (33) | 0,00 |
| | | | | $ (112) | $ (117) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 1.006** | **0,11** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| BASF SE | (1,000)% | 20.12.2020 | € 500 | $ 6 | 0,00 |
| Fortum Oyj | (1,000) | 20.12.2020 | 100 | 0 | 0,00 |
| Reynolds American, Inc. | (1,000) | 20.12.2020 | $ 1.700 | 28 | 0,00 |
| United Utilities PLC | (1,000) | 20.12.2020 | € 600 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 35 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Enbridge, Inc. | 1,000% | 20.12.2022 | $ 300 | $ 5 | 0,00 |
| Exelon Generation Co. LLC | 1,000 | 20.06.2022 | 700 | 30 | 0,00 |
| Shell International Finance BV | 1,000 | 20.12.2026 | € 900 | 66 | 0,01 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2025 | 1.500 | 29 | 0,00 |
| | | | | $ 130 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-32 10-Year Index | (1,000)% | 20.06.2029 | $ 60.400 | $ (101) | (0,01) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-30 5-Year Index | 1,000% | 20.12.2023 | $ 1.600 | $ 28 | 0,00 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 25.500 | 48 | 0,01 |
| iTraxx Crossover 31 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2024 | € 1.800 | 9 | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 11.200 | 37 | 0,00 |
| | | | | $ 122 | 0,01 |

**ZINSSWAPS - BASISSWAPS**

| Zahlung variabler Zinssatzindex | Erhalt variabler Zinssatzindex | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 9,1250 % | 18.03.2022 | $ 363.000 | $ 38 | 0,01 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,084 % | 12.06.2022 | 16.100 | 12 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,070 % | 12.06.2022 | 7.700 | 9 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR | 1-Month USD-LIBOR + 0,085 % | 19.06.2022 | 33.700 | 26 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 8,6250 % | 12.04.2023 | 20.300 | 5 | 0,00 |
| 3-Month USD-LIBOR[4] | 1-Month USD-LIBOR + 8,8000 % | 23.05.2029 | 3.000 | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 89 | 0,01 |

**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 | 2,673% | 30.04.2025 | $ 2.000 | $ (127) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,683 | 30.04.2025 | 6.300 | (407) | (0,04) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,684 | 30.04.2025 | 1.900 | (122) | (0,01) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,696% | 30.04.2025 | $ | 2.000 | $ (130) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,710 | 30.04.2025 | | 2.100 | (138) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,714 | 30.04.2025 | | 4.500 | (297) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,370 | 02.01.2020 | BRL | 202.900 | (92) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 6,450 | 02.01.2020 | | 313.600 | (189) | (0,02) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 8,880 | 04.01.2021 | | 1.500 | 23 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,500 | 19.06.2029 | CAD | 43.000 | 1.404 | 0,15 |
| Zahlung | 3-Month NZD-BBR | 2,500 | 14.02.2020 | NZD | 8.980 | 72 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month SEK-STIBOR | 0,500 | 19.06.2024 | SEK | 56.200 | (4) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 20.06.2020 | $ | 109.700 | (1.830) | (0,19) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 20.06.2023 | | 32.200 | (1.609) | (0,17) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | | 34.800 | (2.911) | (0,30) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,460 | 09.04.2024 | | 9.900 | (301) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | | 10.700 | (1.765) | (0,18) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2020 | | 50.900 | (1.062) | (0,11) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | | 14.900 | (1.229) | (0,13) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,953 | 12.11.2049 | | 1.600 | (258) | (0,03) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,955 | 12.11.2049 | | 6.000 | (970) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | | 10.000 | (62) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | | 16.700 | (544) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2026 | | 16.900 | (822) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2028 | | 2.300 | (269) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | | 45.100 | (2.520) | (0,26) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | | 15.000 | (2.976) | (0,31) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 18.12.2049 | | 700 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,250 | 20.06.2023 | ZAR | 16.700 | 8 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,912 | 30.01.2029 | CZK | 24.300 | 31 | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.09.2021 | € | 77.500 | (215) | (0,02) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2021 | | 51.400 | (34) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2024 | | 19.000 | 84 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | | 102.300 | 2.288 | 0,24 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 18.12.2029 | | 61.700 | 704 | 0,07 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | | 7.600 | 356 | 0,04 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 08.03.2029 | | 14.100 | 452 | 0,05 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | | 700 | (113) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,310 | 19.06.2029 | | 41.000 | 403 | 0,04 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.09.2021 | £ | 16.000 | 126 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2024 | | 45.900 | 53 | 0,01 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2029 | | 6.000 | (22) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.12.2049 | | 1.800 | (34) | 0,00 |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | | 4.500 | 462 | 0,05 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,500 | 20.03.2024 | HUF | 342.600 | 38 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,200 | 19.06.2029 | ¥ | 2.320.000 | (180) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,400 | 19.06.2039 | | 640.000 | (148) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,500 | 19.06.2049 | | 710.000 | 286 | 0,03 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 | 21.03.2048 | | 70.000 | 23 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,825 | 12.01.2023 | MXN | 29.700 | 59 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,730 | 25.02.2027 | | 24.500 | 24 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,740 | 22.02.2027 | | 25.500 | 30 | 0,00 |
| | | | | | | $ (14.451) | (1,49) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ (14.176)** | **(1,47)** |

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**DEVISENOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | | Verfallsdatum | Nennbetrag[4] | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| HUS | Call - OTC AUD versus CAD | CAD | 0,940 | 13.09.2019 | 7.000 | $ 20 | $ 14 | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus INR | INR | 82,000 | 16.10.2019 | 15.000 | 106 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 126 | $ 15 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs- kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900% | 21.08.2019 | 1.900 | $ (2) | $ 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 1.800 | (2) | (1) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 2.300 | (4) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 3.400 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 2.000 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 2.500 | (5) | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 2.000 | (2) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (21) | $ (3) | 0,00 |

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Put - OTC USD versus COP | COP | 3.165,000 | 29.08.2019 | 3.250 | $ (27) | $ (28) | 0,00 |
| | Put - OTC USD versus ZAR | ZAR | 14,200 | 18.07.2019 | 2.420 | (14) | (38) | (0,01) |
| HUS | Put - OTC AUD versus CAD | CAD | 0,905 | 13.09.2019 | 7.000 | (21) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC USD versus CNH | CNH | 6,795 | 22.07.2019 | 4.900 | (13) | (11) | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus CNH | | 6,945 | 22.07.2019 | 4.900 | (9) | (15) | 0,00 |
| | | | | | | $ (84) | $ (119) | (0,01) |

### INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Floor - OTC CPURNSA | $ 217,965 | Maximal [(1 + 0,000 %)[10] - (Index Final/Index Initial)] oder 0 | 29.09.2020 | 1.300 | $ (17) | $ 0 | 0,00 |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits- datum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt- twert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Japan Government International Bond | (1,000)% | 20.06.2022 | $ 500 | $ (17) | $ 4 | $ (13) | 0,00 |
| BPS | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 1.900 | (68) | 17 | (51) | (0,01) |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 3.100 | (76) | (15) | (91) | (0,01) |
| BRC | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.600 | (31) | (11) | (42) | 0,00 |
| | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 2.600 | (91) | 22 | (69) | (0,01) |
| | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 4.400 | (111) | (19) | (130) | (0,01) |
| CBK | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 3.400 | (120) | 30 | (90) | (0,01) |
| GST | China Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 2.900 | (56) | (20) | (76) | (0,01) |
| | Japan Government International Bond | (1,000) | 20.06.2022 | 3.300 | (115) | 27 | (88) | (0,01) |
| HUS | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 1.500 | (38) | (6) | (44) | 0,00 |
| JPM | South Korea Government International Bond | (1,000) | 20.06.2023 | 2.100 | (50) | (12) | (62) | (0,01) |
| | | | | | $ (773) | $ 17 | $ (756) | (0,08) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits- datum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | South Africa Government International Bond | 1,000% | 20.06.2023 | $ 100 | $ (5) | $ 4 | $ (1) | 0,00 |
| GST | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.700 | (75) | 23 | (52) | (0,01) |
| JPM | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 600 | (32) | 23 | (9) | 0,00 |
| | | | | | $ (112) | $ 50 | $ (62) | (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.

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,787% | 20.03.2029 | KRW 2.348.300 | $ 0 | $ 68 | $ 68 | 0,01 |
| BPS | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,180 | 30.01.2024 | ILS 10.000 | 0 | 72 | 72 | 0,01 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,786 | 01.05.2029 | 2.300 | 0 | 20 | 20 | 0,00 |
| CBK | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,755 | 29.04.2029 | 3.600 | 0 | 28 | 28 | 0,00 |
| GLM | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,779 | 30.04.2029 | 3.300 | 0 | 28 | 28 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,780 | 22.04.2029 | 3.200 | 0 | 27 | 27 | 0,00 |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,718 | 19.06.2029 | KRW 1.204.200 | 0 | 29 | 29 | 0,00 |
| JPM | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,775 | 25.04.2029 | ILS 7.800 | 2 | 64 | 66 | 0,01 |
| NGF | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,725 | 20.03.2024 | KRW 10.706.000 | 0 | 134 | 134 | 0,02 |
| SCX | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,795 | 20.03.2029 | 1.851.000 | 0 | 55 | 55 | 0,01 |
| | | | | | | $ 2 | $ 525 | $ 527 | 0,06 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | $ 2.600 | 20.03.2020 | $ 16 | $ (88) | $ (72) | (0,01) |
| GST | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 3.300 | 20.09.2019 | 0 | (244) | (244) | (0,02) |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 7.800 | 20.12.2019 | 2 | (480) | (478) | (0,05) |
| | | | | | | | $ 18 | $ (812) | $ (794) | (0,08) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 1.382 | $ | 948 | $ 0 | $ (22) | $ (22) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 2.595 | | 1.952 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 185.423 | | 28.325 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 173.411 | | 193.764 | 0 | (3.716) | (3.716) | (0,38) |
| | 07/2019 | ¥ | 116.400 | | 1.075 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 16.840 | AUD | 24.127 | 91 | 0 | 91 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 210.757 | € | 185.496 | 487 | 0 | 487 | 0,05 |
| | 07/2019 | | 949 | £ | 747 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 31 | NOK | 264 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.842 | NZD | 7.444 | 158 | 0 | 158 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 905 | TRY | 5.244 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 18.564 | $ | 12.978 | 0 | (64) | (64) | (0,01) |
| | 08/2019 | € | 177.710 | | 202.464 | 0 | (429) | (429) | (0,04) |
| | 08/2019 | $ | 3.305 | RUB | 217.107 | 116 | 0 | 116 | 0,01 |
| | 09/2019 | SGD | 6.593 | $ | 4.817 | 0 | (62) | (62) | (0,01) |
| | 11/2019 | TWD | 13.620 | | 434 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 3.524 | € | 710 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | AUD | 5.547 | $ | 3.861 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 1.278 | | 971 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 6.535 | | 6.604 | 3 | (102) | (99) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 13.654 | | 15.382 | 5 | (173) | (168) | (0,02) |
| | 07/2019 | ¥ | 94.473 | | 884 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 515 | | 59 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 1.354 | | 889 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 07/2019 | RON | 12.364 | | 2.935 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 159.338 | | 2.470 | 0 | (52) | (52) | (0,01) |
| | 07/2019 | SEK | 1.620 | | 172 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.956 | CAD | 3.933 | 54 | 0 | 54 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.604 | CNH | 10.988 | 0 | (5 | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 9.955 | € | 8.859 | 134 | 0 | 134 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 70.966 | £ | 55.951 | 243 | 0 | 243 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 4.603 | ¥ | 495.700 | 0 | (2 | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.542 | NOK | 21.780 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 14.284 | SEK | 132.500 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 55.951 | $ | 71.074 | 0 | (245) | (245) ) | (0,03) |
| | 09/2019 | € | 71 | TRY | 482 | 0 | (1) | (1 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 233.430 | $ | 198 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 4.602 | CNH | 31.921 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 4.688 | COP | 15.838.512 | 224 | 0 | 224 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 822 | IDR | 11.864.770 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 10/2019 | INR | 254.497 | $ | 3.617 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 3.072 | € | 619 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 05/2020 | $ | 8.414 | INR | 618.177 | 204 | 0 | 204 | 0,02 |
| BRC | 07/2019 | DKK | 21.950 | $ | 3.345 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.251 | HKD | 9.789 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 9.789 | $ | 1.252 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 04/2020 | INR | 621.088 | | 8.561 | 0 | (104) | (104) | (0,01) |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | ARS | 24.259 | $ | 498 | $ 0 | $ (51) | $ (51) | (0,01) |
| | 07/2019 | AUD | 18.564 | | 12.851 | 0 | (176) | (176) | (0,02) |
| | 07/2019 | CAD | 678 | | 503 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 3.185 | | 3.196 | 0 | (71) | (71) | (0,01) |
| | 07/2019 | CNH | 11.609 | | 1.722 | 33 | 0 | 33 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 46.030 | | 7.002 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 11.151 | | 12.673 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 707 | | 895 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | KRW | 2.355.630 | | 2.022 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 53.662 | | 6.228 | 7 | (73) | (66) | (0,01) |
| | 07/2019 | RUB | 181.526 | | 2.804 | 0 | (69) | (69) | (0,01) |
| | 07/2019 | SEK | 37.137 | | 3.951 | 0 | (52) | (52) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 2.927 | AUD | 4.208 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.322 | CAD | 4.394 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.602 | CNH | 10.988 | 0 | (4) ) | (4) ) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 42.702 | DKK | 280.766 | 137 | 0 | 137 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 10.500 | € | 9.274 | 61 | 0 | 61 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 931 | £ | 731 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.993 | ¥ | 321.815 | 4 | (10) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.619 | PLN | 13.506 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 7.791 | SEK | 72.994 | 77 | 0 | 77 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 405 | TRY | 2.353 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 50.372 | $ | 2.544 | 0 | (59) | (59) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 2.329 | HKD | 18.235 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 3.366 | NOK | 28.604 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 74.370 | $ | 10.716 | 0 | (100) | (100) | (0,01) |
| | 09/2019 | € | 347 | TRY | 2.357 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 186 | PEN | 628 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 280.766 | $ | 43.031 | 0 | (136) | (136) | (0,01) |
| | 10/2019 | PEN | 15.358 | | 4.608 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 4.487 | MXN | 88.026 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 978 | RON | 4.128 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 18.235 | $ | 2.330 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 03/2020 | RON | 3.094 | € | 623 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| CIB | 07/2019 | $ | 333 | CAD | 450 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| DUB | 09/2019 | | 926 | CNH | 6.417 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.196 | IDR | 17.265.456 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| FBF | 11/2019 | | 405 | TWD | 12.654 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | CHF | 886 | $ | 913 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | CLP | 1.439.267 | | 2.123 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 2.440 | | 368 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 1.947 | | 2.471 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 278.256 | | 4.255 | 0 | (149) | (149) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 4.255 | € | 3.752 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 975 | NZD | 1.482 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 113 | PLN | 425 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 8.450 | RUB | 560.825 | 425 | 0 | 425 | 0,04 |
| | 08/2019 | MXN | 32.493 | $ | 1.635 | 0 | (45) | (45) | 0,00 |
| | 08/2019 | RUB | 286.729 | | 4.355 | 0 | (153) | (153) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ | 4.948 | MXN | 98.619 | 149 | 0 | 149 | 0,02 |
| | 09/2019 | CNH | 5.346 | $ | 771 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 2.123 | CLP | 1.439.267 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 4.404 | IDR | 64.448.037 | 115 | 0 | 115 | 0,01 |
| | 10/2019 | MXN | 98.619 | $ | 4.895 | 0 | (150) | (150) | (0,02) |
| | 10/2019 | $ | 542 | MXN | 10.593 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 2.252 | RON | 9.605 | 55 | 0 | 55 | 0,01 |
| | 03/2020 | € | 612 | | 2.976 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 19.027 | $ | 14.115 | 0 | (446) | (446) | (0,05) |
| | 07/2019 | CNH | 76.395 | | 11.196 | 80 | 0 | 80 | 0,01 |
| | 07/2019 | NZD | 2.979 | | 1.973 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.234 | ARS | 61.217 | 151 | 0 | 151 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 10.290 | CAD | 13.713 | 204 | 0 | 204 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 5.043 | CHF | 4.927 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.228 | CLP | 854.442 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 11.534 | CNH | 79.160 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 19 | € | 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 135.335 | ¥ | 14.564.073 | 0 | (157) | (157) | (0,02) |
| | 07/2019 | | 3.888 | NOK | 33.870 | 85 | 0 | 85 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.316 | TRY | 7.616 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | CHF | 4.927 | $ | 5.058 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 14.564.073 | | 135.654 | 152 | 0 | 152 | 0,02 |
| | 08/2019 | $ | 2.692 | HKD | 21.090 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 229.480 | $ | 33.023 | 0 | (350) | (350) | (0,04) |
| | 09/2019 | $ | 3.441 | CNH | 23.803 | 24 | (3) | 21 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 371 | IDR | 5.362.050 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 10/2019 | INR | 210.289 | $ | 2.861 | 0 | (144) | (144) | (0,01) |
| | 10/2019 | $ | 6.413 | INR | 464.786 | 229 | 0 | 229 | 0,02 |
| | 10/2019 | | 3.069 | PEN | 10.321 | 56 | 0 | 56 | 0,01 |
| | 11/2019 | TWD | 119.120 | $ | 3.806 | 0 | (64) | (64) | (0,01) |
| | 11/2019 | $ | 1.425 | TWD | 44.424 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 33.702 | $ | 4.310 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 04/2020 | $ | 8.464 | INR | 621.088 | 202 | 0 | 202 | 0,02 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| IND | 07/2019 | SEK | 453.468 | $ | 47.307 | $ 0 | $ (1.568) | $ (1.568) | (0,16) |
| JPM | 07/2019 | CHF | 1.932 | | 1.930 | 0 | (52) | (52) | (0,01) |
| | 07/2019 | CNH | 3.804 | | 559 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 18.030 | | 2.737 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 4.180 | RON | 19.817 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 25.321 | $ | 28.601 | 0 | (234) | (234) | (0,02) |
| | 07/2019 | £ | 2.992 | | 3.766 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| | 07/2019 | INR | 593.187 | | 8.457 | 0 | (132) | (132) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 15.375.606 | | 141.107 | 0 | (1.603) | (1.603) | (0,17) |
| | 07/2019 | KRW | 864.282 | | 742 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | SEK | 132.500 | | 14.282 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.961 | CHF | 3.913 | 52 | 0 | 52 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 682 | DKK | 4.495 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 795 | € | 703 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.467 | £ | 2.751 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.435 | INR | 308.822 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.220 | NOK | 18.875 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.126 | PLN | 4.203 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 975 | SEK | 9.256 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 439 | TRY | 2.549 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 15.458 | $ | 780 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 14.315 | SEK | 132.500 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 7.007 | $ | 1.010 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 3.957 | CNH | 27.166 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 646 | IDR | 9.320.488 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 19.817 | € | 4.142 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 17.538 | $ | 561 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 11/2019 | $ | 1.415 | TWD | 43.865 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 05/2020 | INR | 308.822 | $ | 4.286 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | CNH | 9.328 | | 1.365 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07/2019 | RON | 7.453 | € | 1.541 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 2.227 | RUB | 147.340 | 84 | 0 | 84 | 0,01 |
| | 03/2020 | RON | 3.099 | € | 624 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | AUD | 2.827 | $ | 1.971 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 1.005 | | 1.008 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 12.615 | | 1.919 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 33.059 | | 3.897 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4.847 | ZAR | 71.052 | 188 | 0 | 188 | 0,02 |
| | 08/2019 | | 1.460 | HKD | 11.432 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 12/2019 | HKD | 11.432 | $ | 1.461 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 06/2021 | $ | 69 | € | 54 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| NGF | 09/2019 | TRY | 2.844 | | 418 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | $ | 369 | CAD | 500 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 3.554 | € | 745 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 2.247 | RON | 9.638 | 67 | 0 | 67 | 0,01 |
| | 03/2020 | € | 733 | | 3.554 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | CAD | 5.190 | $ | 3.879 | 0 | (93) | (93) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 60.048 | | 76.002 | 0 | (421) | (421) | (0,04) |
| | 07/2019 | ¥ | 526.421 | | 4.852 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 12.051 | | 1.377 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 224 | CAD | 300 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.793 | £ | 3.795 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.960 | ¥ | 212.309 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 49.074 | SEK | 455.088 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 455.088 | $ | 49.188 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 8.920 | | 1.286 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 1.823 | CNH | 12.603 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 1.581 | TWD | 49.311 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | PLN | 13.069 | $ | 3.472 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | $ | 4.092 | INR | 284.365 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 08/2019 | HKD | 76.232 | $ | 9.747 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 05/2020 | INR | 309.355 | | 4.303 | 0 | (9) | (9 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ | 845 | CLP | 584.825 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | NZD | 5.925 | $ | 3.923 | 0 | (56) | (56) | (0,01) |
| | 07/2019 | TRY | 17.762 | | 2.982 | 0 | (83) | (83) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 13.100 | € | 11.684 | 206 | 0 | 206 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 5.079 | £ | 4.000 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08/2019 | HKD | 13.473 | $ | 1.723 | 0 | (2 | (2 | 0,00 |
| | 03/2020 | € | 1.263 | RON | 6.149 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | | | $ 5.277 | $ (12.538) | $ (7.261) | (0,75) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 14.535 | $ | 16.517 | $ 0 | $ (36) | $ (36) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 16.559 | € | 14.535 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Bond Ex-US Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | € | 14.054 | $ | 15.979 | $ 0 | $ (26) | $ (26) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 352 | € | 311 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 15.906 | | 13.954 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | | 15.563 | | 13.916 | 284 | 0 | 284 | 0,03 |
| CBK | 07/2019 | € | 14.547 | $ | 16.532 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 734 | € | 644 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 16.561 | | 14.535 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 42 | $ | 47 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | $ | 15.123 | € | 13.524 | 280 | 0 | 280 | 0,03 |
| RBC | 07/2019 | | 151 | | 133 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | € | 51 | $ | 58 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 9 | | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 263 | € | 234 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € | 124 | $ | 140 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 761 | € | 682 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 15.561 | | 13.916 | 286 | 0 | 286 | 0,03 |
| | | | | | | $ 967 | $ (99) | $ 868 | 0,09 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | £ | 66 | $ | 84 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 84 | £ | 66 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 83 | | 65 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 2 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MEI | 07/2019 | £ | 66 | $ | 84 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 84 | £ | 66 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 83 | | 65 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 80 | | 63 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 1.949 | $ | 1.361 | $ 0 | $ (7) | $ (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 3.898 | | 2.964 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 5.642 | | 6.411 | 0 | (13) | (13 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 620 | CHF | 622 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 89 | NOK | 777 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.362 | AUD | 1.949 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.966 | CAD | 3.898 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 6.428 | € | 5.642 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 208 | SGD | 285 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | DKK | 257 | $ | 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 18.973 | € | 16.965 | 347 | 0 | 347 | 0,04 |
| | 09/2019 | | 306 | MYR | 1.273 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | € | 16.495 | $ | 18.747 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 3.892 | | 4.945 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 3.736 | | 34 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.349 | AUD | 1.949 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 92 | HUF | 26.688 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 17.343 | ¥ | 1.889.475 | 194 | 0 | 194 | 0,02 |
| | 08/2019 | | 18.795 | € | 16.495 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 4.952 | £ | 3.892 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 0 | MXN | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 621 | CNY | 4.299 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 37 | $ | 42 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 622 | | 636 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 1.885.739 | | 17.523 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.892 | CAD | 3.898 | 91 | 0 | 91 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 110 | CZK | 2.546 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 1 | $ | 0 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 638 | CHF | 622 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 17.564 | ¥ | 1.885.739 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 317 | MXN | 6.215 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | | 237 | PLN | 892 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 5.938 | € | 5.310 | 109 | 0 | 109 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 113 | ILS | 411 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| RBC | 07/2019 | € | 26 | $ | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | $ | 313 | DKK | 2.063 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SEK | 4.011 | $ | 433 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4.926 | £ | 3.892 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 140 | RUB | 9.232 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 419 | SEK | 4.011 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 434 | | 4.011 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 283 | IDR | 4.147.139 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.291 | KRW | 1.537.095 | 43 | 0 | 43 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 07/2019 | € | 75 | $ | 84 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 123 | NZD | 188 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.011 | $ (109) | $ 902 | 0,09 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ (6.682)** | **(0,69)** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | | | **$ 1.233.351** | **127,55** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | | | **$ (266.376)** | **(27,55)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | | | **$ 966.975** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(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) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 114.307 als Sicherheiten verpfändet.**

**(j) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 14.146 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 4.589 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 14.576 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 8.200 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 2.304 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | $ (2.351) | $ 2.304 | $ 2.304 | 0,24 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (2.351)** | **$ 2.304** | **$ 2.304** | **0,24** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert** (1)

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 9.726 | $ 1.243.477 | $ 0 | $ 1.253.203 |
| Finanzderivate[3] | 1.006 | (20.858) | 0 | (19.852) |
| **Summen** | **$ 10.732** | **$ 1.222.619** | **$ 0** | **$ 1.233.351** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 11.639 | $ 1.226.679 | $ 0 | $ 1.238.318 |
| Finanzderivate[3] | (2.729) | (2.972) | 0 | (5.701) |
| **Summen** | **$ 8.910** | **$ 1.223.707** | **$ 0** | **$ 1.232.617** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (0,390)% | 28.05.2019 | 18.07.2019 | € (1.766) | $ (2.011) | (0,21) |
| | (0,390) | 31.05.2019 | 18.07.2019 | (2.486) | (2.830) | (0,29) |
| | (0,370) | 17.04.2019 | 18.07.2019 | (4.189) | (4.767) | (0,49) |
| | (0,340) | 28.05.2019 | 18.07.2019 | (3.185) | (3.626) | (0,38) |
| | (0,340) | 03.06.2019 | 18.07.2019 | (9.205) | (10.480) | (1,08) |
| | (0,340) | 21.06.2019 | 18.07.2019 | (9.277) | (10.563) | (1,09) |
| | (0,300) | 17.04.2019 | 18.07.2019 | (12.775) | (14.539) | (1,50) |
| GRE | 2,610 | 29.05.2019 | 10.07.2019 | (1.817) | (1.821) | (0,19) |
| IND | 0,890 | 10.04.2019 | 08.08.2019 | £ (2.248) | (2.866) | (0,30) |
| | 2,570 | 16.05.2019 | 16.07.2019 | $ (12.908) | (12.950) | (1,34) |
| | 2,590 | 23.04.2019 | 23.07.2019 | (9.032) | (9.077) | (0,94) |
| | 2,600 | 06.06.2019 | 18.07.2019 | (19.952) | (19.988) | (2,07) |
| | 2,600 | 25.06.2019 | 25.07.2019 | (10.360) | (10.364) | (1,07) |
| | 2,600 | 28.06.2019 | 25.07.2019 | (1.883) | (1.884) | (0,20) |
| | 2,620 | 19.06.2019 | 12.07.2019 | (2.349) | (2.351) | (0,24) |
| JML | 1,850 | 16.04.2019 | TBD[1] | (612) | (615) | (0,06) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (110.732)** | **(11,45)** |

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkaufgeschäfte[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPG | 2,660% | 11.06.2019 | 10.07.2019 | $ (1.483) | $ (1.485) | (0,15) |
| TDM | 1,790 | 13.06.2019 | 12.07.2019 | CAD (1.042) | (798) | (0,08) |
| | 1,900 | 13.06.2019 | 12.07.2019 | (15.504) | (11.876) | (1,23) |
| **Summe Rückkaufgeschäfte** | | | | | **$ (14.159)** | **(1,46)** |

[1] In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag ist USD 8 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (3.393) | $ 3.230 | $ (163) |
| BPS | 163 | (300) | (137) |
| BRC | 212 | (370) | (158) |
| CBK | (373) | 260 | (113) |
| CIB | 11 | 0 | 11 |
| DUB | 20 | (40) | (20) |
| FBF | 6 | 0 | 6 |
| GLM | 288 | (220) | 68 |
| GST | (940) | 920 | (20) |
| HUS | 41 | 390 | 431 |
| IND | (1.568) | 1.450 | (118) |
| JPM | (1.974) | 1.850 | (124) |
| MSB | 44 | 0 | 44 |
| MYC | 0 | (740) | (740) |
| MYI | 550 | (310) | 240 |
| NGF | 138 | 0 | 138 |
| RBC | 1 | 0 | 1 |
| RYL | 82 | (75) | 7 |
| SCX | (358) | 90 | (268) |
| SOG | (34) | 0 | (34) |
| SSB | 20 | 0 | 20 |
| TOR | 303 | (310) | (7) |
| UAG | 79 | 0 | 79 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 89,21 | 80,82 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 40,15 | 47,68 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,24 | 0,06 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,11 | (0,28) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,47) | 0,08 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,69) | (0,39) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (11,45) | (10,33) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (1,46) | (2,84) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,14 | 0,14 |
| Australien | 0,59 | 0,62 |
| Belgien | 0,09 | 0,08 |
| Brasilien | 0,59 | 0,53 |
| Kanada | 2,99 | 4,83 |
| Cayman-Inseln | 4,20 | 4,46 |
| China | 2,80 | 0,00 |
| Dänemark | 4,46 | 3,20 |
| Finnland | 0,07 | 0,07 |
| Frankreich | 3,19 | 3,38 |
| Deutschland | 4,16 | 2,49 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,24 | 0,18 |
| Hongkong | 0,40 | 0,48 |
| Indien | 0,28 | 0,15 |
| Indonesien | 0,06 | 0,05 |
| Irland | 1,92 | 2,50 |
| Italien | 5,01 | 3,10 |
| Japan | 19,16 | 11,66 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,02 | 0,02 |
| Kuwait | 0,76 | 0,72 |
| Litauen | 0,17 | 0,17 |
| Luxemburg | 2,31 | 2,91 |
| Multinational | 0,15 | 0,16 |
| Niederlande | 3,05 | 2,68 |
| Norwegen | 0,77 | 0,75 |
| Peru | 0,72 | 0,00 |
| Polen | 0,36 | 0,36 |
| Portugal | 0,03 | 0,04 |
| Katar | 1,27 | 0,32 |
| Russland | 0,97 | 0,00 |
| Saudi-Arabien | 1,91 | 1,84 |
| Singapur | 0,29 | 0,29 |
| Slowenien | 0,39 | 1,68 |
| Südkorea | 1,05 | 0,04 |
| Spanien | 5,25 | 3,08 |
| Supranational | 0,90 | 0,36 |
| Schweden | 2,40 | 5,32 |
| Schweiz | 2,03 | 2,21 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,67 | 0,49 |
| Großbritannien | 11,57 | 12,57 |
| Vereinigte Staaten | 41,50 | 42,79 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,24 | 11,79 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,47 | 0,05 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,12 | (0,28) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | 0,00 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,01 | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,01) | 0,28 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | (0,02) |
| Zinsswaps — Basisswaps | 0,01 | 0,01 |
| Zinsswaps | (1,49) | (0,20) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | 0,00 | 0,02 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,01) |
| Devisenoptionen | (0,01) | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | (0,08) | (0,07) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | 0,01 |
| Cross-Currency Swaps | 0,00 | 0,07 |
| Zinsswaps | 0,06 | (0,02) |
| Total Return Swaps auf Indizes | (0,08) | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | (0,75) | (0,42) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,18 | 0,07 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (27,55) | (27,97) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **BERMUDA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Digicel Group Two Ltd. (7,125 % bar und 2,000 % PIK)** | | | | |
| 9,125 % fällig am 01.04.2024 (b) | $ | 2.511 | $ 552 | 0,01 |
| **Viking Cruises Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2027 | | 7.475 | 7.587 | 0,20 |
| **VOC Escrow Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2028 | | 5.000 | 5.094 | 0,14 |
| Summe Bermuda | | | 13.233 | 0,35 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bausch Health Cos., Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | € | 7.000 | 8.093 | 0,21 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2023 | $ | 795 | 804 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 01.11.2025 | | 10.000 | 10.463 | 0,28 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2027 | | 5.000 | 5.267 | 0,14 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2023 | | 2.892 | 2.937 | 0,08 |
| 6,125 % fällig am 15.04.2025 | | 2.000 | 2.047 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 15.03.2022 | | 1.500 | 1.556 | 0,04 |
| 7,000 % fällig am 15.03.2024 | | 4.000 | 4.260 | 0,11 |
| 7,000 % fällig am 15.01.2028 | | 3.000 | 3.116 | 0,08 |
| 7,250 % fällig am 30.05.2029 | | 4.000 | 4.170 | 0,11 |
| 9,000 % fällig am 15.12.2025 | | 2.000 | 2.242 | 0,06 |
| **B.C. Unlimited Liability Co.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2024 | | 5.000 | 5.069 | 0,13 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2025 | | 13.500 | 13.639 | 0,36 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.03.2022 | | 3.000 | 3.056 | 0,08 |
| 7,500 % fällig am 01.12.2024 | | 2.250 | 2.301 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 15.03.2025 | | 7.500 | 7.549 | 0,20 |
| 7,875 % fällig am 15.04.2027 | | 4.500 | 4.517 | 0,12 |
| 8,750 % fällig am 01.12.2021 | | 7.000 | 7.656 | 0,20 |
| **First Quantum Minerals Ltd.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.03.2024 | | 2.000 | 1.878 | 0,05 |
| 6,875 % fällig am 01.03.2026 | | 2.250 | 2.095 | 0,06 |
| 7,250 % fällig am 01.04.2023 | | 2.500 | 2.444 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 01.04.2025 | | 2.000 | 1.913 | 0,05 |
| **Masonite International Corp.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | | 3.000 | 3.101 | 0,08 |
| **MDC Partners, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.05.2024 | | 2.000 | 1.848 | 0,05 |
| **Open Text Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2026 | | 7.000 | 7.422 | 0,20 |
| **Teck Resources Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2021 | | 5.000 | 5.092 | 0,14 |
| **Teine Energy Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 30.09.2022 | | 3.050 | 3.119 | 0,08 |
| **Videotron Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2022 | | 2.500 | 2.628 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 15.04.2027 | | 3.000 | 3.139 | 0,08 |
| Summe Kanada | | | 123.421 | 3,26 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 1.875 | 1.929 | 0,05 |
| **Noble Holding International Ltd.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.02.2026 | | 5.000 | 4.320 | 0,12 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 10.000 | 10.583 | 0,28 |
| **Transocean Poseidon Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.02.2027 | | 3.000 | 3.178 | 0,08 |
| **Transocean Proteus Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.12.2024 | | 3.000 | 3.109 | 0,08 |
| **Transocean, Inc.** | | | | |
| 6,800 % fällig am 15.03.2038 | | 5.000 | 3.775 | 0,10 |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 2.500 | 2.378 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 15.01.2026 | | 3.000 | 2.873 | 0,08 |
| 7,500 % fällig am 15.04.2031 | | 10.000 | 8.550 | 0,23 |
| 9,000 % fällig am 15.07.2023 | | 10.000 | 10.687 | 0,28 |
| **UPCB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.06.2029 | € | 4.000 | 4.846 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 15.01.2025 | $ | 7.000 | 7.212 | 0,19 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | $ | 5.000 | $ 4.875 | 0,13 |
| Summe Cayman Inseln | | | 68.315 | 1,81 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DKT Finance ApS** | | | | |
| 9,375 % fällig am 17.06.2023 | | 6.000 | 6.516 | 0,17 |
| **Norican A/S** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2023 | € | 8.500 | 9.082 | 0,24 |
| Summe Dänemark | | | 15.598 | 0,41 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.05.2024 | $ | 5.254 | 5.431 | 0,14 |
| 7,375 % fällig am 01.05.2026 | | 12.750 | 13.101 | 0,35 |
| 8,125 % fällig am 01.02.2027 | | 3.500 | 3.684 | 0,10 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 19.08.2025 (e)(g) | | 8.000 | 8.896 | 0,24 |
| **Burger King France S.A.S.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.05.2024 | € | 1.225 | 1.497 | 0,04 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 23.01.2024 (e)(g) | $ | 10.000 | 11.037 | 0,29 |
| **Crown European Holdings S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 30.09.2024 | € | 1.000 | 1.233 | 0,03 |
| 3,375 % fällig am 15.05.2025 | | 1.000 | 1.268 | 0,03 |
| **La Financiere Atalian SASU** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.05.2024 | | 5.000 | 4.293 | 0,11 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2025 | | 3.475 | 2.977 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 15.05.2025 | £ | 2.500 | 2.382 | 0,06 |
| **Newco GB S.A.S. (8,000 % bar oder 8,000 % PIK)** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 (b) | € | 3.200 | 3.783 | 0,10 |
| **Novasep Holding S.A.S. (5,000 % bar und 3,000 % PIK)** | | | | |
| 8,000 % fällig am 31.05.2022 (b) | | 1.436 | 1.590 | 0,04 |
| | | | 61.172 | 1,61 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **WARRANTS** | | | | |
| **Novasep Holding SAS - Exp. 31.05.2022** | | 456.300 | 234 | 0,01 |
| Summe Frankreich | | | 61.406 | 1,62 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CeramTec BondCo GmbH** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.12.2025 | € | 10.000 | 11.644 | 0,31 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b) | | 2.750 | 3.209 | 0,08 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b) | | 10.000 | 11.569 | 0,31 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (b) | | 2.750 | 3.187 | 0,08 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK)** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2026 (b) | $ | 6.000 | 5.873 | 0,16 |
| **Nidda BondCo GmbH** | | | | |
| 5,000 % fällig am 30.09.2025 | € | 12.500 | 14.048 | 0,37 |
| **Nidda Healthcare Holding GmbH** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.09.2024 | | 12.250 | 14.440 | 0,38 |
| **Platin GmbH** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.06.2023 | | 5.000 | 5.765 | 0,15 |
| **Unitymedia GmbH** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2027 | | 2.000 | 2.418 | 0,06 |
| 6,125 % fällig am 15.01.2025 | $ | 6.000 | 6.271 | 0,17 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2025 | | 3.000 | 3.105 | 0,08 |
| **WEPA Hygieneprodukte GmbH** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.05.2024 (i) | € | 7.000 | 8.162 | 0,22 |
| Summe Deutschland | | | 89.691 | 2,37 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **IRLAND** | | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (f)** | | 1.129.800 | $ 114.663 | 3,03 |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)** | | 771.456 | 8.178 | 0,22 |
| Summe Irland | | | 122.841 | 3,25 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **EVOCA SpA** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.10.2023 | € | 5.000 | 6.012 | 0,16 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | $ | 9.250 | 9.282 | 0,25 |
| 5,710 % fällig am 15.01.2026 | | 5.000 | 5.065 | 0,13 |
| 6,250 % fällig am 16.05.2024 (e)(g) | € | 5.500 | 6.451 | 0,17 |
| 7,700 % fällig am 17.09.2025 (e)(g) | $ | 7.000 | 6.883 | 0,18 |
| **Nexi Capital SpA** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.11.2023 | € | 5.000 | 5.914 | 0,16 |
| **Telecom Italia SpA** | | | | |
| 5,303 % fällig am 30.05.2024 | $ | 19.000 | 19.736 | 0,52 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 8,000 % fällig am 03.06.2024 (e)(g) | | 7.000 | 6.784 | 0,18 |
| 9,250 % fällig am 03.06.2022 (e)(g) | € | 3.000 | 3.829 | 0,10 |
| **Wind Tre SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 20.01.2023 | | 3.000 | 3.449 | 0,09 |
| 3,125 % fällig am 20.01.2025 | | 5.000 | 5.692 | 0,15 |
| 5,000 % fällig am 20.01.2026 | $ | 2.500 | 2.432 | 0,07 |
| Summe Italien | | | 81.529 | 2,16 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adient Global Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.08.2026 | | 7.000 | 5.600 | 0,15 |
| **LHC3 PLC (4,125 % bar oder 4,875 % PIK)** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.08.2024 (b) | € | 5.000 | 5.854 | 0,15 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 11.454 | 0,30 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **NVHL S.A. 'A' (c)(h)** | | 32.110 | 58 | 0,00 |
| **NVHL S.A. 'B' (c)(h)** | | 32.110 | 58 | 0,00 |
| **NVHL S.A. 'C' (c)(h)** | | 32.110 | 58 | 0,00 |
| **NVHL S.A. 'D' (c)(h)** | | 32.110 | 58 | 0,00 |
| **NVHL S.A. 'E' (c)(h)** | | 32.110 | 58 | 0,00 |
| **NVHL S.A. 'F' (c)(h)** | | 32.110 | 59 | 0,01 |
| **NVHL S.A. 'G' (c)(h)** | | 32.110 | 59 | 0,01 |
| **NVHL S.A. 'H' (c)(h)** | | 32.110 | 59 | 0,00 |
| **NVHL S.A. 'I' (c)(h)** | | 32.110 | 59 | 0,00 |
| **NVHL S.A. 'J' (c)(h)** | | 32.110 | 59 | 0,00 |
| Summe Stammaktien | | | 585 | 0,02 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.02.2023 | $ | 4.000 | 4.110 | 0,11 |
| 7,500 % fällig am 15.05.2026 | | 7.750 | 7.809 | 0,21 |
| **Altice Finco S.A.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | € | 3.000 | 2.989 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | $ | 3.750 | $ 3.541 | 0,09 |
| **Cirsa Finance International SARL** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.05.2025 | € | 1.150 | 1.381 | 0,04 |
| 6,250 % fällig am 20.12.2023 | | 3.800 | 4.714 | 0,12 |
| **FAGE International S.A.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.08.2026 | $ | 3.000 | 2.655 | 0,07 |
| **Garfunkelux Holdco S.A.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.11.2022 | £ | 2.250 | 2.577 | 0,07 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.08.2023 | $ | 5.000 | 4.587 | 0,12 |
| 8,000 % fällig am 15.02.2024 | | 4.000 | 4.180 | 0,11 |
| **Lincoln Financing SARL** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2024 | € | 4.000 | 4.727 | 0,12 |
| **Mallinckrodt International Finance S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2025 (i) | $ | 3.000 | 2.025 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 01.08.2022 (i) | | 3.000 | 2.595 | 0,07 |
| **Nielsen Co. Luxembourg SARL** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2025 (i) | | 5.000 | 4.937 | 0,13 |
| **Swissport Financing SARL** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.12.2021 | € | 7.000 | 8.253 | 0,22 |
| **Telecom Italia Capital S.A.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.11.2033 | $ | 7.000 | 7.297 | 0,19 |
| 7,200 % fällig am 18.07.2036 | | 3.000 | 3.323 | 0,09 |
| **Telenet Finance Luxembourg Notes SARL** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2028 | € | 5.000 | 5.915 | 0,16 |
| **Trinseo Materials Operating S.C.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.09.2025 | $ | 7.000 | 6.772 | 0,18 |
| | | | 84.387 | 2,23 |
| Summe Luxemburg | | | 84.972 | 2,25 |
| **MULTINATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ardagh Packaging Finance PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.02.2025 | | 6.000 | 6.232 | 0,16 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2024 | | 5.000 | 5.288 | 0,14 |
| **Endo Dac** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2023 | | 3.273 | 2.373 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 01.02.2025 | | 5.000 | 3.375 | 0,09 |
| **Starfruit Finco BV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2026 | € | 12.000 | 13.858 | 0,37 |
| 8,000 % fällig am 01.10.2026 | $ | 2.500 | 2.581 | 0,07 |
| Summe multinational | | | 33.707 | 0,89 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Alcoa Nederland Holding BV** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2024 | | 1.000 | 1.061 | 0,03 |
| 7,000 % fällig am 30.09.2026 | | 1.500 | 1.613 | 0,04 |
| **Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.01.2025 | € | 7.500 | 8.918 | 0,24 |
| **Constellium NV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | $ | 2.000 | 2.060 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 15.02.2026 | | 6.000 | 6.180 | 0,16 |
| **Diamond BC BV** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.08.2025 | € | 20.000 | 19.160 | 0,51 |
| **Energizer Gamma Acquisition BV** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2026 | | 3.625 | 4.332 | 0,11 |
| **Schoeller Allibert Group BV** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.10.2021 | | 5.000 | 5.851 | 0,16 |
| **Sensata Technologies BV** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.10.2023 | $ | 5.000 | 5.231 | 0,14 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2025 | | 5.000 | 5.237 | 0,14 |
| **Sigma Holdco BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2026 | € | 9.500 | 10.257 | 0,27 |
| 7,875 % fällig am 15.05.2026 | $ | 2.000 | 1.860 | 0,05 |
| **Stars Group Holdings BV** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.07.2026 | | 3.500 | 3.710 | 0,10 |
| **Sunshine Mid BV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.05.2026 | € | 5.000 | 5.928 | 0,16 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 2,200 % fällig am 21.07.2021 | $ | 8.000 | 7.620 | 0,20 |
| 3,150 % fällig am 01.10.2026 | | 7.000 | 5.442 | 0,14 |
| **UPC Holding BV** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.06.2029 | € | 7.000 | 8.401 | 0,22 |
| **Ziggo Bond Co. BV** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2025 | $ | 5.000 | $ 5.077 | 0,13 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2027 | | 7.750 | 7.808 | 0,21 |
| **Ziggo BV** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2027 | | 12.000 | 12.267 | 0,32 |
| Summe Niederlande | | | 128.013 | 3,38 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Mulhacen Pte. Ltd. (6,500 % bar oder 7,250 % PIK)** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.08.2023 (b) | € | 4.375 | 4.808 | 0,13 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Tasty Bondco 1 S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.05.2026 | | 5.000 | 6.029 | 0,16 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Intrum AB** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.07.2022 | | 2.000 | 2.307 | 0,06 |
| 3,125 % fällig am 15.07.2024 (i) | | 4.000 | 4.626 | 0,12 |
| Summe Schweden | | | 6.933 | 0,18 |
| **AKTIEN** | | | | |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **Bibby Offshore Services PLC (c)(h)** | | 257.031 | 2.323 | 0,06 |
| | | PARI (000S) | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Afren PLC** | | | | |
| 0,112 % fällig am 25.04.2049 ^(d)(h) | $ | 4.993 | 622 | 0,02 |
| 10,250 % fällig am 08.04.2019 ^ | | 9.691 | 82 | 0,00 |
| **Arqiva Broadcast Finance PLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2023 | £ | 5.000 | 6.861 | 0,18 |
| **Avon International Capital PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.08.2022 (a) | $ | 2.375 | 2.399 | 0,06 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2024 (e)(g) | £ | 3.000 | 3.708 | 0,10 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (e)(g) | | 3.000 | 3.986 | 0,11 |
| **eG Global Finance PLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 07.02.2025 | $ | 3.500 | 3.481 | 0,09 |
| **Ensco Rowan PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.10.2024 | | 2.000 | 1.500 | 0,04 |
| 5,200 % fällig am 15.03.2025 | | 2.000 | 1.480 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 01.10.2044 | | 7.500 | 4.350 | 0,12 |
| 7,750 % fällig am 01.02.2026 | | 5.000 | 3.750 | 0,10 |
| **Heathrow Finance PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.03.2027 | £ | 10.000 | 12.436 | 0,33 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.11.2025 | € | 2.250 | 2.547 | 0,07 |
| 2,875 % fällig am 01.05.2026 | | 5.000 | 5.779 | 0,15 |
| **International Game Technology PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2022 | $ | 7.000 | 7.429 | 0,20 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2025 | | 10.000 | 10.975 | 0,29 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 27.06.2024 (e)(g) | | 5.750 | 6.059 | 0,16 |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (e)(g) | £ | 7.000 | 9.721 | 0,26 |
| **Nomad Foods Bondco PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2024 | € | 3.000 | 3.548 | 0,09 |
| **NWEN Finance PLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 21.06.2021 | £ | 3.250 | 4.302 | 0,11 |
| **Pizzaexpress Financing PLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.08.2021 | | 5.000 | 5.606 | 0,15 |
| **RAC Bond Co. PLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 06.11.2022 | | 5.000 | 5.752 | 0,15 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,648 % fällig am 30.09.2031 (e) | $ | 7.500 | 9.806 | 0,26 |
| **Sensata Technologies UK Financing Co. PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2026 | | 8.000 | 8.540 | 0,23 |
| **Virgin Media Finance PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2025 | $ | 3.250 | $ 3.376 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 15.10.2024 | | 4.000 | 4.160 | 0,11 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | £ | 3.000 | 3.947 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2026 | $ | 7.500 | 7.713 | 0,20 |
| 5,500 % fällig am 15.08.2026 | | 6.000 | 6.232 | 0,16 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | |
| 7,000 % fällig am 04.04.2079 | | 1.325 | 1.432 | 0,04 |
| | | | 151.579 | 4,01 |
| Summe Großbritannien | | | 153.902 | 4,07 |
| **USA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adient U.S. LLC** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.05.2026 | | 1.000 | 1.030 | 0,03 |
| **ADT Security Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 3.000 | 3.004 | 0,08 |
| 4,125 % fällig am 15.06.2023 | | 5.000 | 5.009 | 0,13 |
| 4,875 % fällig am 15.07.2032 | | 5.000 | 4.338 | 0,11 |
| **Advanced Disposal Services, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.11.2024 | | 7.000 | 7.359 | 0,19 |
| **AECOM** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.03.2027 | | 5.000 | 5.225 | 0,14 |
| **Air Medical Group Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2023 | | 10.000 | 9.000 | 0,24 |
| **Albertsons Cos. LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.06.2024 | | 2.000 | 2.083 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 15.03.2026 | | 5.000 | 5.362 | 0,14 |
| **Allied Universal Holdco LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.07.2026 (a) | | 2.250 | 2.289 | 0,06 |
| **Allison Transmission, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.10.2027 | | 2.000 | 1.995 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2024 | | 1.000 | 1.024 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 01.06.2029 | | 2.000 | 2.110 | 0,06 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.04.2021 | | 3.500 | 3.579 | 0,09 |
| 5,125 % fällig am 30.09.2024 | | 3.000 | 3.248 | 0,09 |
| 7,500 % fällig am 15.09.2020 | | 3.469 | 3.660 | 0,10 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2020 | | 5.161 | 5.359 | 0,14 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 3.689 | 4.874 | 0,13 |
| **AMC Networks, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.08.2025 | | 2.000 | 2.028 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 01.04.2024 | | 5.000 | 5.156 | 0,14 |
| **American Builders & Contractors Supply Co., Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.12.2023 | | 6.000 | 6.232 | 0,16 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 3.000 | 3.139 | 0,08 |
| **Amsted Industries, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.07.2027 | | 2.750 | 2.874 | 0,08 |
| **Antero Midstream Partners LP** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.09.2024 | | 2.500 | 2.497 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | | 2.000 | 2.005 | 0,05 |
| **Antero Resources Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.12.2022 | | 2.000 | 1.928 | 0,05 |
| **Aramark Services, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.06.2026 | | 3.000 | 3.060 | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 01.04.2025 | | 1.250 | 1.272 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2028 | | 4.000 | 4.125 | 0,11 |
| 5,125 % fällig am 15.01.2024 | | 5.000 | 5.150 | 0,14 |
| **Arconic, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2024 | | 9.000 | 9.511 | 0,25 |
| 5,900 % fällig am 01.02.2027 | | 3.000 | 3.269 | 0,09 |
| 5,950 % fällig am 01.02.2037 | | 5.000 | 5.205 | 0,14 |
| **Ashland LLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.08.2022 | | 2.500 | 2.622 | 0,07 |
| 6,875 % fällig am 15.05.2043 | | 5.000 | 5.412 | 0,14 |
| **Associated Materials LLC** | | | | |
| 9,000 % fällig am 01.01.2024 | | 11.000 | 10.477 | 0,28 |
| **Avon International Operations, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.08.2022 | | 5.500 | 5.734 | 0,15 |
| **Axalta Coating Systems LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.08.2024 | | 2.000 | 2.070 | 0,05 |
| **B&G Foods, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.04.2025 | | 5.000 | 5.069 | 0,13 |
| **Bausch Health Americas, Inc.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 31.01.2027 | | 2.000 | 2.204 | 0,06 |
| 9,250 % fällig am 01.04.2026 | | 5.000 | 5.606 | 0,15 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **BBA U.S. Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.05.2026 | $ | 4.000 | $ 4.160 | 0,11 |
| **BCD Acquisition, Inc.** | | | | |
| 9,625 % fällig am 15.09.2023 | | 6.000 | 6.322 | 0,17 |
| **Beacon Roofing Supply, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.11.2025 | | 17.500 | 17.391 | 0,46 |
| 6,375 % fällig am 01.10.2023 | | 5.000 | 5.219 | 0,14 |
| **Berry Global Escrow Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2026 | | 4.000 | 4.095 | 0,11 |
| **Berry Global, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.02.2026 | | 4.000 | 3.950 | 0,10 |
| 5,125 % fällig am 15.07.2023 | | 2.000 | 2.052 | 0,05 |
| **Blue Racer Midstream LLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.11.2022 | | 10.000 | 10.187 | 0,27 |
| **BMC East LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2024 | | 5.000 | 5.087 | 0,13 |
| **Boise Cascade Co.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.09.2024 | | 5.000 | 5.125 | 0,14 |
| **Boyd Gaming Corp.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.04.2026 | | 3.000 | 3.185 | 0,08 |
| 6,875 % fällig am 15.05.2023 | | 3.000 | 3.109 | 0,08 |
| **Brazos Valley Longhorn LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.02.2025 | | 5.000 | 4.725 | 0,13 |
| **Brink's Co.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.10.2027 | | 5.000 | 5.006 | 0,13 |
| **Bruin E&P Partners LLC** | | | | |
| 8,875 % fällig am 01.08.2023 | | 3.000 | 2.535 | 0,07 |
| **Builders FirstSource, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.09.2024 | | 6.000 | 6.207 | 0,16 |
| **BWAY Holding Co.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2024 | | 10.000 | 10.042 | 0,27 |
| **Cablevision Systems Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2022 | | 5.000 | 5.262 | 0,14 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2025 | | 15.000 | 15.084 | 0,40 |
| **Calpine Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2026 | | 5.000 | 5.106 | 0,14 |
| 5,375 % fällig am 15.01.2023 | | 10.000 | 10.141 | 0,27 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2025 | | 5.000 | 4.981 | 0,13 |
| **Catalent Pharma Solutions, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.12.2024 | € | 3.250 | 3.868 | 0,10 |
| 4,875 % fällig am 15.01.2026 | $ | 3.700 | 3.769 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 15.07.2027 | | 2.000 | 2.040 | 0,05 |
| **CCO Holdings LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2028 | | 5.000 | 5.118 | 0,14 |
| 5,125 % fällig am 15.02.2023 | | 5.000 | 5.091 | 0,13 |
| 5,125 % fällig am 01.05.2027 | | 10.000 | 10.379 | 0,27 |
| 5,250 % fällig am 30.09.2022 | | 5.000 | 5.085 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 01.05.2025 | | 3.000 | 3.109 | 0,08 |
| 5,375 % fällig am 01.06.2029 | | 2.000 | 2.070 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 01.05.2026 | | 5.000 | 5.245 | 0,14 |
| 5,750 % fällig am 15.02.2026 | | 7.000 | 7.359 | 0,19 |
| 5,875 % fällig am 01.04.2024 | | 4.250 | 4.452 | 0,12 |
| 5,875 % fällig am 01.05.2027 | | 5.000 | 5.287 | 0,14 |
| **Centene Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2025 | | 1.000 | 1.035 | 0,03 |
| 5,625 % fällig am 15.02.2021 | | 4.000 | 4.080 | 0,11 |
| 6,125 % fällig am 15.02.2024 | | 2.400 | 2.517 | 0,07 |
| **CenturyLink, Inc.** | | | | |
| 5,800 % fällig am 15.03.2022 | | 5.000 | 5.237 | 0,14 |
| 6,450 % fällig am 15.06.2021 | | 3.000 | 3.180 | 0,08 |
| 7,500 % fällig am 01.04.2024 (i) | | 4.000 | 4.435 | 0,12 |
| **CF Industries, Inc.** | | | | |
| 5,150 % fällig am 15.03.2034 | | 9.000 | 8.842 | 0,23 |
| **Change Healthcare Holdings LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.03.2025 | | 10.500 | 10.697 | 0,28 |
| **Chemours Co.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2027 | | 3.000 | 2.873 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 15.05.2023 | | 1.810 | 1.879 | 0,05 |
| 7,000 % fällig am 15.05.2025 | | 5.000 | 5.237 | 0,14 |
| **Cheniere Corpus Christi Holdings LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.06.2027 | | 9.000 | 9.799 | 0,26 |
| 7,000 % fällig am 30.06.2024 | | 5.000 | 5.763 | 0,15 |
| **Cheniere Energy Partners LP** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.10.2025 | | 5.000 | 5.187 | 0,14 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.10.2024 | | 4.000 | 3.605 | 0,10 |
| 8,000 % fällig am 15.01.2025 (i) | $ | 3.000 | $ 2.798 | 0,07 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2027 | | 1.750 | 1.551 | 0,04 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 10.000 | 10.636 | 0,28 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2023 | | 5.500 | 5.892 | 0,16 |
| **Clean Harbors, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2027 (a) | | 2.750 | 2.802 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 15.07.2029 (a) | | 1.375 | 1.406 | 0,04 |
| **Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2022 | | 7.500 | 7.706 | 0,20 |
| 9,250 % fällig am 15.02.2024 | | 6.500 | 7.069 | 0,19 |
| **Clearway Energy Operating LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.09.2026 | | 4.000 | 3.947 | 0,10 |
| 5,375 % fällig am 15.08.2024 | | 1.500 | 1.534 | 0,04 |
| **CNX Resources Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.04.2022 | | 2.750 | 2.681 | 0,07 |
| **Colfax Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 4.000 | 4.716 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 15.02.2024 | $ | 3.000 | 3.184 | 0,08 |
| 6,375 % fällig am 15.02.2026 | | 1.250 | 1.342 | 0,04 |
| **CommScope Technologies LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | | 5.000 | 4.375 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 15.06.2025 | | 4.500 | 4.240 | 0,11 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2024 | | 2.000 | 2.063 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 15.06.2024 | | 3.125 | 2.997 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 01.03.2026 | | 2.500 | 2.575 | 0,07 |
| 8,250 % fällig am 01.03.2027 | | 2.275 | 2.329 | 0,06 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2021 | | 6.000 | 5.887 | 0,16 |
| 6,250 % fällig am 31.03.2023 | | 6.000 | 5.797 | 0,15 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2026 | | 4.000 | 3.859 | 0,10 |
| **Cooper-Standard Automotive, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.11.2026 | | 5.000 | 4.463 | 0,12 |
| **Core & Main LP** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.08.2025 | | 15.000 | 15.225 | 0,40 |
| **Cornerstone Building Brands, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.04.2026 | | 14.000 | 13.685 | 0,36 |
| **Coty, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.04.2023 | € | 2.000 | 2.254 | 0,06 |
| 6,500 % fällig am 15.04.2026 | $ | 5.000 | 4.881 | 0,13 |
| **Covanta Holding Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.03.2024 | | 4.000 | 4.130 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 01.07.2025 | | 3.000 | 3.131 | 0,08 |
| **CPG Merger Sub LLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.10.2021 | | 8.000 | 8.150 | 0,22 |
| **Crestwood Midstream Partners LP** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.05.2027 | | 2.000 | 2.000 | 0,05 |
| **Crown Americas LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.09.2026 | | 6.000 | 6.142 | 0,16 |
| 4,750 % fällig am 01.02.2026 | | 4.750 | 4.892 | 0,13 |
| **CrownRock LP** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.10.2025 | | 7.000 | 7.044 | 0,19 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2024 | | 6.000 | 6.247 | 0,17 |
| 5,375 % fällig am 01.02.2028 | | 2.250 | 2.343 | 0,06 |
| 5,500 % fällig am 15.05.2026 | | 5.000 | 5.256 | 0,14 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2027 | | 7.500 | 7.894 | 0,21 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.08.2022 | | 2.750 | 2.798 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | | 7.000 | 7.306 | 0,19 |
| **Darling Ingredients, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.04.2027 | | 5.550 | 5.814 | 0,15 |
| **DaVita, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.05.2025 | | 6.000 | 5.946 | 0,16 |
| 5,125 % fällig am 15.07.2024 | | 3.750 | 3.761 | 0,10 |
| **DCP Midstream Operating LP** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.09.2021 | | 4.250 | 4.367 | 0,12 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.06.2021 | | 2.250 | 2.288 | 0,06 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 4.000 | 4.223 | 0,11 |
| **Dell, Inc.** | | | | |
| 7,100 % fällig am 15.04.2028 | | 1.500 | 1.680 | 0,04 |
| **Diamond Offshore Drilling, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.11.2043 | | 2.000 | 1.250 | 0,03 |
| 5,700 % fällig am 15.10.2039 | | 2.750 | 1.856 | 0,05 |
| 7,875 % fällig am 15.08.2025 | | 4.000 | 3.820 | 0,10 |
| **Diamond Resorts International, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | $ | 5.000 | $ 5.169 | 0,14 |
| **Diamondback Energy, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.11.2024 | | 3.000 | 3.098 | 0,08 |
| 5,375 % fällig am 31.05.2025 | | 4.000 | 4.215 | 0,11 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2023 | | 5.000 | 4.850 | 0,13 |
| 5,875 % fällig am 15.07.2022 | | 10.000 | 10.187 | 0,27 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | | 7.000 | 6.650 | 0,18 |
| 6,750 % fällig am 01.06.2021 | | 5.000 | 5.256 | 0,14 |
| 7,750 % fällig am 01.07.2026 | | 5.000 | 4.862 | 0,13 |
| **Dun & Bradstreet Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.08.2026 | | 8.000 | 8.465 | 0,22 |
| **Eagle Holding Co. LLC (7,750 % bar oder 7,750 % PIK)** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 (b) | | 4.250 | 4.293 | 0,11 |
| **Element Solutions, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.12.2025 | | 5.000 | 5.231 | 0,14 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.06.2023 | | 4.000 | 3.983 | 0,11 |
| **Endeavor Energy Resources LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 30.01.2026 | | 3.000 | 3.124 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 30.01.2028 | | 4.000 | 4.230 | 0,11 |
| **Energizer Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.06.2025 | | 8.000 | 8.120 | 0,21 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.10.2020 | | 5.000 | 5.305 | 0,14 |
| **EnLink Midstream LLC** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.06.2029 | | 7.500 | 7.706 | 0,20 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.02.2026 | € | 4.000 | 4.782 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 15.05.2027 | $ | 5.000 | 5.372 | 0,14 |
| 5,875 % fällig am 15.01.2026 | | 5.000 | 5.306 | 0,14 |
| **ESH Hospitality, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.05.2025 | | 10.000 | 10.262 | 0,27 |
| **Extraction Oil & Gas, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2026 | | 2.000 | 1.625 | 0,04 |
| 7,375 % fällig am 15.05.2024 | | 1.000 | 860 | 0,02 |
| **First Data Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2024 | | 10.000 | 10.251 | 0,27 |
| **First Quality Finance Co., Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.05.2021 | | 3.000 | 3.004 | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2025 | | 3.500 | 3.535 | 0,09 |
| **Flex Acquisition Co., Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.01.2025 | | 7.000 | 6.370 | 0,17 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 5.000 | 5.162 | 0,14 |
| **Freeport-McMoRan, Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.03.2022 | | 4.000 | 4.025 | 0,11 |
| 3,875 % fällig am 15.03.2023 | | 2.000 | 2.005 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 14.11.2021 | | 3.000 | 3.068 | 0,08 |
| 5,400 % fällig am 14.11.2034 | | 12.000 | 11.550 | 0,31 |
| **Frontier Communications Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.04.2027 | | 3.000 | 3.128 | 0,08 |
| 8,500 % fällig am 01.04.2026 | | 5.000 | 4.862 | 0,13 |
| **Gartner, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.04.2025 | | 6.000 | 6.183 | 0,16 |
| **Gates Global LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2022 | | 5.152 | 5.162 | 0,14 |
| **Genesis Energy LP** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.05.2026 | | 3.000 | 2.910 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 4.000 | 3.925 | 0,10 |
| 6,750 % fällig am 01.08.2022 | | 4.000 | 4.050 | 0,11 |
| **Graphic Packaging International LLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.08.2024 | | 2.500 | 2.550 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 15.11.2022 | | 2.000 | 2.083 | 0,06 |
| **Gray Television, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.10.2024 | | 1.000 | 1.021 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 15.07.2026 | | 2.500 | 2.600 | 0,07 |
| **Greystar Real Estate Partners LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.12.2025 | | 6.250 | 6.391 | 0,17 |
| **Griffon Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.03.2022 | | 5.000 | 4.994 | 0,13 |
| **Gulfport Energy Corp.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.10.2024 | | 4.000 | 3.110 | 0,08 |
| 6,375 % fällig am 15.05.2025 | | 4.000 | 3.115 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 01.05.2023 | | 2.000 | 1.730 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Hanesbrands, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.05.2024 | $ | 5.000 | $ 5.216 | 0,14 |
| 4,875 % fällig am 15.05.2026 | | 5.000 | 5.212 | 0,14 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.02.2025 | | 5.000 | 5.409 | 0,14 |
| 5,875 % fällig am 01.05.2023 | | 6.000 | 6.539 | 0,17 |
| 5,875 % fällig am 15.02.2026 | | 3.500 | 3.876 | 0,10 |
| 7,500 % fällig am 15.02.2022 | | 7.000 | 7.735 | 0,20 |
| **Herc Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.07.2027 (a) | | 2.500 | 2.522 | 0,07 |
| **Hill-Rom Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2025 | | 7.000 | 7.245 | 0,19 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2030 | | 4.000 | 4.130 | 0,11 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.04.2025 | | 3.000 | 3.079 | 0,08 |
| 4,875 % fällig am 01.04.2027 | | 3.500 | 3.630 | 0,10 |
| **Hologic, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.10.2025 | | 6.250 | 6.367 | 0,17 |
| 4,625 % fällig am 01.02.2028 | | 5.500 | 5.596 | 0,15 |
| **Howard Hughes Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.03.2025 | | 5.000 | 5.191 | 0,14 |
| **Hughes Satellite Systems Corp.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.08.2026 | | 3.000 | 3.094 | 0,08 |
| **Indigo Natural Resources LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2026 | | 5.000 | 4.513 | 0,12 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.09.2025 | € | 3.000 | 3.554 | 0,09 |
| 3,250 % fällig am 15.03.2025 | | 3.000 | 3.531 | 0,09 |
| 4,875 % fällig am 15.05.2023 | $ | 2.000 | 2.055 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2026 | | 7.000 | 7.254 | 0,19 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2027 | | 4.000 | 4.140 | 0,11 |
| **Jaguar Holding Co.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.08.2023 | | 22.500 | 23.344 | 0,62 |
| **Jeld-Wen, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.12.2025 | | 7.000 | 6.886 | 0,18 |
| 4,875 % fällig am 15.12.2027 | | 7.000 | 6.790 | 0,18 |
| **Jonah Energy LLC** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.10.2025 (i) | | 4.500 | 2.194 | 0,06 |
| **KAR Auction Services, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.06.2025 | | 5.000 | 5.112 | 0,14 |
| **KFC Holding Co.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.06.2027 | | 3.500 | 3.596 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 01.06.2024 | | 5.400 | 5.596 | 0,15 |
| 5,250 % fällig am 01.06.2026 | | 5.000 | 5.256 | 0,14 |
| **Kinetic Concepts Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.02.2021 | | 4.377 | 4.493 | 0,12 |
| 12,500 % fällig am 01.11.2021 | | 7.700 | 8.499 | 0,22 |
| **LABL Escrow Issuer LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.07.2026 (a) | | 5.000 | 5.056 | 0,13 |
| **Lamb Weston Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.11.2024 | | 2.500 | 2.603 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 01.11.2026 | | 5.000 | 5.225 | 0,14 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.05.2010 ^ | | 14.200 | 246 | 0,01 |
| **Lennar Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.11.2027 | | 5.000 | 5.287 | 0,14 |
| 5,000 % fällig am 15.06.2027 | | 3.000 | 3.165 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 01.06.2026 | | 6.500 | 6.947 | 0,18 |
| 5,375 % fällig am 01.10.2022 | | 2.000 | 2.128 | 0,06 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2023 | | 3.000 | 3.036 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 15.03.2026 | | 3.000 | 3.113 | 0,08 |
| 5,375 % fällig am 15.01.2024 | | 2.000 | 2.050 | 0,05 |
| 5,375 % fällig am 01.05.2025 | | 5.000 | 5.175 | 0,14 |
| **Live Nation Entertainment, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.11.2024 | | 4.000 | 4.125 | 0,11 |
| **Marriott Ownership Resorts, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.09.2026 | | 2.500 | 2.694 | 0,07 |
| **Matterhorn Merger Sub LLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 01.06.2026 | | 8.000 | 7.140 | 0,19 |
| **MDC Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2043 | | 5.000 | 4.700 | 0,12 |
| **MGM Growth Properties Operating Partnership LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.09.2026 | | 4.000 | 4.125 | 0,11 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2028 | | 2.000 | 1.995 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 01.05.2024 | | 4.000 | 4.325 | 0,11 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 4,625 % fällig am 01.09.2026 | $ | 8.500 | $ 8.585 | 0,23 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2027 | | 2.000 | 2.103 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 15.06.2025 | | 4.000 | 4.371 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 15.03.2023 | | 5.000 | 5.431 | 0,14 |
| 6,625 % fällig am 15.12.2021 | | 10.000 | 10.825 | 0,29 |
| 7,750 % fällig am 15.03.2022 | | 5.000 | 5.587 | 0,15 |
| **Moog, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2022 | | 4.000 | 4.080 | 0,11 |
| **MSCI, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.08.2026 | | 1.750 | 1.820 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 15.11.2024 | | 2.000 | 2.075 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2025 | | 4.500 | 4.748 | 0,13 |
| **Nabors Industries, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | | 2.500 | 2.350 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2025 | | 5.250 | 4.679 | 0,12 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 25.10.2024 | | 5.000 | 5.081 | 0,13 |
| 6,125 % fällig am 25.03.2024 | | 5.000 | 5.150 | 0,14 |
| 6,500 % fällig am 15.06.2022 | | 2.000 | 2.129 | 0,06 |
| 6,625 % fällig am 26.07.2021 | | 4.000 | 4.245 | 0,11 |
| 6,750 % fällig am 25.06.2025 | | 2.000 | 2.075 | 0,06 |
| 7,250 % fällig am 25.01.2022 | | 2.500 | 2.706 | 0,07 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 3.000 | 3.113 | 0,08 |
| **NCR Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.02.2021 | | 3.000 | 3.015 | 0,08 |
| 6,375 % fällig am 15.12.2023 | | 3.400 | 3.515 | 0,09 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2027 | € | 5.000 | 6.234 | 0,16 |
| 4,375 % fällig am 15.11.2026 (i) | $ | 8.000 | 8.202 | 0,22 |
| 4,875 % fällig am 15.04.2028 | | 6.000 | 6.202 | 0,16 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | | 2.000 | 2.129 | 0,06 |
| **Nexstar Broadcasting, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.08.2024 | | 3.000 | 3.115 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2022 | | 3.000 | 3.075 | 0,08 |
| **Nexstar Escrow, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.07.2027 (a) | | 3.000 | 3.079 | 0,08 |
| **NextEra Energy Operating Partners LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.07.2024 | | 2.125 | 2.142 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 15.09.2024 | | 3.000 | 3.027 | 0,08 |
| 4,500 % fällig am 15.09.2027 | | 5.000 | 4.956 | 0,13 |
| **NGL Energy Partners LP** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.03.2025 | | 2.500 | 2.488 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 01.11.2023 | | 3.000 | 3.150 | 0,08 |
| **NGPL PipeCo LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.08.2022 | | 2.000 | 2.070 | 0,05 |
| 4,875 % fällig am 15.08.2027 | | 3.000 | 3.188 | 0,08 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2022 | | 5.000 | 5.012 | 0,13 |
| **Novelis Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.09.2026 | | 12.000 | 12.180 | 0,32 |
| 6,250 % fällig am 15.08.2024 | | 5.000 | 5.255 | 0,14 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.01.2027 | | 6.000 | 6.540 | 0,17 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2026 | | 5.000 | 5.525 | 0,15 |
| **NSG Holdings LLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.12.2025 | | 2.485 | 2.677 | 0,07 |
| **Olin Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2030 | | 4.000 | 3.980 | 0,11 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2022 | | 25.000 | 24.000 | 0,63 |
| **Outfront Media Capital LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2027 | | 3.000 | 3.079 | 0,08 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.08.2022 ^ | | 2.250 | 2.171 | 0,06 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | | 1.500 | 1.429 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2020 ^ | | 2.000 | 1.960 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 01.08.2023 ^ | | 1.000 | 1.008 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 15.11.2043 ^ | | 500 | 514 | 0,01 |
| 6,050 % fällig am 01.03.2034 ^ | | 1.000 | 1.120 | 0,03 |
| **Park-Ohio Industries, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.04.2027 | | 4.000 | 4.020 | 0,11 |
| **Parsley Energy LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.08.2025 | | 2.000 | 2.040 | 0,05 |
| 5,375 % fällig am 15.01.2025 | | 7.250 | 7.467 | 0,20 |
| 6,250 % fällig am 01.06.2024 | | 5.000 | 5.212 | 0,14 |
| **PDC Energy, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2026 | | 4.000 | 3.940 | 0,10 |
| 6,125 % fällig am 15.09.2024 | | 5.000 | 5.012 | 0,13 |
| **PetSmart, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2025 | $ | 4.000 | $ 3.900 | 0,10 |
| **Pilgrim's Pride Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.03.2025 | | 10.000 | 10.175 | 0,27 |
| 5,875 % fällig am 30.09.2027 | | 2.000 | 2.080 | 0,06 |
| **Pinnacle Operating Corp.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.05.2023 | | 865 | 294 | 0,01 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2026 | | 12.000 | 12.210 | 0,32 |
| 5,500 % fällig am 15.12.2029 (a) | | 2.000 | 2.013 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 15.01.2028 | | 6.000 | 6.187 | 0,16 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | | 10.000 | 10.375 | 0,27 |
| 8,000 % fällig am 15.07.2025 | | 3.000 | 3.225 | 0,09 |
| **PQ Corp.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.11.2022 | | 3.500 | 3.637 | 0,10 |
| **Prime Security Services Borrower LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.04.2024 | | 5.000 | 5.100 | 0,13 |
| 9,250 % fällig am 15.05.2023 | | 1.773 | 1.865 | 0,05 |
| **Qorvo, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.07.2026 | | 5.000 | 5.304 | 0,14 |
| **Qualitytech LP** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.11.2025 | | 7.000 | 6.965 | 0,18 |
| **Quicken Loans, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | | 4.000 | 3.995 | 0,11 |
| 5,750 % fällig am 01.05.2025 | | 4.000 | 4.145 | 0,11 |
| **Rackspace Hosting, Inc.** | | | | |
| 8,625 % fällig am 15.11.2024 (i) | | 5.000 | 4.613 | 0,12 |
| **Range Resources Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 5.000 | 4.769 | 0,13 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2023 | | 3.000 | 2.839 | 0,08 |
| **RBS Global, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.12.2025 | | 10.000 | 10.175 | 0,27 |
| **Refinitiv U.S. Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2026 | € | 7.000 | 8.175 | 0,22 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2026 | $ | 3.750 | 3.866 | 0,10 |
| 6,875 % fällig am 15.11.2026 | € | 7.500 | 8.715 | 0,23 |
| 8,250 % fällig am 15.11.2026 | $ | 4.000 | 4.124 | 0,11 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 01.05.2023 | | 7.000 | 7.455 | 0,20 |
| **Revlon Consumer Products Corp.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.08.2024 | | 2.000 | 1.380 | 0,04 |
| **Reynolds Group Issuer, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.07.2023 | | 8.000 | 8.170 | 0,22 |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | | 1.040 | 1.044 | 0,03 |
| 7,000 % fällig am 15.07.2024 | | 4.000 | 4.144 | 0,11 |
| **RHP Hotel Properties LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2023 | | 5.000 | 5.094 | 0,13 |
| **Rite Aid Corp.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.04.2023 | | 5.000 | 4.238 | 0,11 |
| **Rowan Cos., Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2024 | | 3.500 | 2.678 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 01.06.2022 | | 2.000 | 1.850 | 0,05 |
| 5,400 % fällig am 01.12.2042 | | 1.000 | 587 | 0,02 |
| 5,850 % fällig am 15.01.2044 | | 3.500 | 2.048 | 0,05 |
| 7,375 % fällig am 15.06.2025 | | 2.000 | 1.560 | 0,04 |
| **Sabre GLBL, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.11.2023 | | 5.000 | 5.175 | 0,14 |
| **Scientific Games International, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.02.2026 | € | 6.750 | 7.738 | 0,20 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2026 | | 3.500 | 3.882 | 0,10 |
| 10,000 % fällig am 01.12.2022 | $ | 545 | 574 | 0,02 |
| **Sealed Air Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.12.2024 | | 2.500 | 2.638 | 0,07 |
| 5,250 % fällig am 01.04.2023 | | 5.000 | 5.275 | 0,14 |
| 6,500 % fällig am 01.12.2020 | | 2.000 | 2.075 | 0,06 |
| **ServiceMaster Co. LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.11.2024 | | 7.500 | 7.734 | 0,20 |
| 7,450 % fällig am 15.08.2027 | | 2.500 | 2.691 | 0,07 |
| **Sinclair Television Group, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2027 | | 4.000 | 3.940 | 0,10 |
| 5,625 % fällig am 01.08.2024 | | 5.000 | 5.125 | 0,14 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2026 | | 2.000 | 2.052 | 0,05 |
| **Sirius XM Radio, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2027 | | 5.000 | 5.106 | 0,14 |
| 5,375 % fällig am 15.04.2025 | | 5.000 | 5.175 | 0,14 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2029 | | 2.250 | 2.312 | 0,06 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Sotera Health Holdings LLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.05.2023 | $ | 8.000 | $ | 8.120 | 0,21 |
| **Sotera Health Topco, Inc. (8,125 % bar oder 8,875 % PIK)** | | | | | |
| 8,125 % fällig am 01.11.2021 (b) | | 7.500 | | 7.500 | 0,20 |
| **Southwestern Energy Co.** | | | | | |
| 6,200 % fällig am 23.01.2025 | | 5.000 | | 4.588 | 0,12 |
| 7,500 % fällig am 01.04.2026 | | 5.000 | | 4.762 | 0,13 |
| **Spectrum Brands, Inc.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.10.2026 | € | 4.000 | | 4.813 | 0,13 |
| 5,750 % fällig am 15.07.2025 | $ | 8.000 | | 8.350 | 0,22 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.05.2022 | | 2.250 | | 2.424 | 0,06 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 4.000 | | 4.310 | 0,11 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 | | 3.000 | | 3.158 | 0,08 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | | 5.000 | | 5.487 | 0,15 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2026 | | 2.750 | | 3.018 | 0,08 |
| **Sprint Capital Corp.** | | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | | 10.000 | | 11.600 | 0,31 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 7.000 | | 7.315 | 0,19 |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 5.000 | | 5.194 | 0,14 |
| **Sprint Corp.** | | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 7.000 | | 7.440 | 0,20 |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 10.000 | | 10.650 | 0,28 |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | | 7.000 | | 7.472 | 0,20 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | | 15.000 | | 16.331 | 0,43 |
| **SPX FLOW, Inc.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.08.2024 | | 7.500 | | 7.856 | 0,21 |
| 5,875 % fällig am 15.08.2026 | | 7.000 | | 7.385 | 0,20 |
| **SRC Energy, Inc.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.12.2025 | | 5.000 | | 4.575 | 0,12 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | | 4.975 | 0,13 |
| 5,000 % fällig am 15.02.2027 | | 8.000 | | 8.120 | 0,21 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2024 | | 6.000 | | 6.232 | 0,16 |
| 6,000 % fällig am 15.10.2025 | | 7.625 | | 8.130 | 0,22 |
| **Staples, Inc.** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2026 | | 10.000 | | 9.966 | 0,26 |
| **Station Casinos LLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2025 | | 5.000 | | 5.025 | 0,13 |
| **Steel Dynamics, Inc.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2026 | | 5.000 | | 5.225 | 0,14 |
| 5,250 % fällig am 15.04.2023 | | 3.000 | | 3.056 | 0,08 |
| **Stericycle, Inc.** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.07.2024 | | 5.000 | | 5.232 | 0,14 |
| **Sunoco LP** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2023 | | 3.000 | | 3.071 | 0,08 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2026 | | 2.500 | | 2.609 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2028 | | 2.000 | | 2.078 | 0,05 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2026 | | 4.000 | | 4.110 | 0,11 |
| 4,750 % fällig am 01.02.2028 | | 5.625 | | 5.808 | 0,15 |
| 5,125 % fällig am 15.04.2025 | | 1.000 | | 1.045 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 15.04.2027 | | 5.000 | | 5.369 | 0,14 |
| 6,375 % fällig am 01.03.2025 | | 3.125 | | 3.253 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 15.01.2026 | | 6.375 | | 6.908 | 0,18 |
| **Talen Energy Supply LLC** | | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 (a) | | 1.000 | | 998 | 0,03 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2027 | | 3.125 | | 3.211 | 0,09 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | | 5.081 | 0,13 |
| **Targa Resources Partners LP** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.11.2023 | | 2.000 | | 2.008 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | | 5.025 | 0,13 |
| 5,125 % fällig am 01.02.2025 | | 2.000 | | 2.075 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 01.05.2023 | | 2.500 | | 2.541 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 15.07.2027 | | 4.000 | | 4.375 | 0,12 |
| **Team Health Holdings, Inc.** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.02.2025 (i) | | 10.000 | | 7.700 | 0,20 |
| **Tempo Acquisition LLC** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.06.2025 | | 7.000 | | 7.245 | 0,19 |
| **Tempur Sealy International, Inc.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.06.2026 | | 3.000 | | 3.124 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 15.10.2023 | | 4.000 | | 4.130 | 0,11 |
| **Tenet Healthcare Corp.** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2024 | | 4.750 | | 4.827 | 0,13 |
| 5,125 % fällig am 01.05.2025 | | 9.000 | | 9.067 | 0,24 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2020 | | 2.000 | | 2.066 | 0,05 |
| 6,250 % fällig am 01.02.2027 | $ | 5.000 | $ | 5.181 | 0,14 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2023 | | 5.000 | | 5.037 | 0,13 |
| 8,125 % fällig am 01.04.2022 | | 5.000 | | 5.262 | 0,14 |
| **Terex Corp.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2025 | | 5.000 | | 5.081 | 0,13 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 31.01.2023 | | 5.000 | | 5.019 | 0,13 |
| 5,000 % fällig am 31.01.2028 | | 7.500 | | 7.556 | 0,20 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2025 | | 3.000 | | 3.161 | 0,08 |
| **TransDigm, Inc.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2022 | | 4.000 | | 4.050 | 0,11 |
| 6,250 % fällig am 15.03.2026 | | 6.000 | | 6.330 | 0,17 |
| 6,375 % fällig am 15.06.2026 | | 5.000 | | 5.056 | 0,13 |
| 6,500 % fällig am 15.07.2024 | | 3.000 | | 3.045 | 0,08 |
| **TreeHouse Foods, Inc.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.02.2024 | | 4.000 | | 4.170 | 0,11 |
| **TriMas Corp.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.10.2025 | | 7.000 | | 7.101 | 0,19 |
| **U.S. Concrete, Inc.** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.06.2024 | | 9.125 | | 9.536 | 0,25 |
| **U.S. Foods, Inc.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.06.2024 | | 7.500 | | 7.734 | 0,20 |
| **United Rentals North America, Inc.** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.10.2025 | | 1.000 | | 1.019 | 0,03 |
| 4,875 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | | 5.112 | 0,14 |
| 5,500 % fällig am 15.07.2025 | | 3.500 | | 3.653 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 15.05.2027 | | 6.000 | | 6.330 | 0,17 |
| 5,875 % fällig am 15.09.2026 | | 2.500 | | 2.672 | 0,07 |
| **Univar USA, Inc.** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.07.2023 | | 5.000 | | 5.119 | 0,14 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2023 | | 5.000 | | 4.912 | 0,13 |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | | 13.000 | | 12.431 | 0,33 |
| 6,750 % fällig am 15.09.2022 | | 1.859 | | 1.897 | 0,05 |
| **Vantiv LLC** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2025 | £ | 7.000 | | 9.326 | 0,25 |
| **VeriSign, Inc.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.07.2027 | $ | 3.000 | | 3.135 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 01.04.2025 | | 2.000 | | 2.143 | 0,06 |
| **Versum Materials, Inc.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 30.09.2024 | | 5.000 | | 5.369 | 0,14 |
| **ViaSat, Inc.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2025 | | 6.000 | | 5.925 | 0,16 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2027 | | 750 | | 782 | 0,02 |
| **Vistra Energy Corp.** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 01.11.2024 | | 3.000 | | 3.180 | 0,08 |
| **Vistra Operations Co. LLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 31.07.2027 | | 3.000 | | 3.116 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 15.02.2027 | | 5.000 | | 5.312 | 0,14 |
| **Welbilt, Inc.** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 15.02.2024 | | 4.750 | | 5.160 | 0,14 |
| **WellCare Health Plans, Inc.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.04.2025 | | 4.000 | | 4.185 | 0,11 |
| **WESCO Distribution, Inc.** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.12.2021 | | 2.000 | | 2.023 | 0,05 |
| 5,375 % fällig am 15.06.2024 | | 3.500 | | 3.605 | 0,10 |
| **West Street Merger Sub, Inc.** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.09.2025 | | 14.000 | | 13.020 | 0,34 |
| **WMG Acquisition Corp.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2023 | | 1.000 | | 1.024 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2026 | | 3.500 | | 3.622 | 0,10 |
| **WPX Energy, Inc.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2022 | | 4.000 | | 4.190 | 0,11 |
| 8,250 % fällig am 01.08.2023 | | 3.000 | | 3.435 | 0,09 |
| **WR Grace & Co-Conn** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2021 | | 5.000 | | 5.212 | 0,14 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.05.2023 | | 3.000 | | 3.004 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 15.05.2027 | | 7.000 | | 7.035 | 0,19 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 6.000 | | 6.212 | 0,16 |
| **Yum! Brands, Inc.** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.11.2037 | | 2.000 | | 2.115 | 0,06 |
| **Zayo Group LLC** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2027 | | 7.000 | | 7.150 | 0,19 |
| 6,375 % fällig am 15.05.2025 | | 3.000 | | 3.071 | 0,08 |
| | | | | 2.162.373 | 57,16 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 4,253 % fällig am 25.03.2036^ | $ 70 | $ 60 | 0,00 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,700 % fällig am 19.10.2036^ | 446 | 338 | 0,01 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,520 % fällig am 19.03.2037 | 142 | 139 | 0,00 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | |
| 4,802 % fällig am 25.02.2036^ | 195 | 182 | 0,01 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 3,344 % fällig am 25.05.2036^ | 61 | 11 | 0,00 |
| 3,474 % fällig am 25.05.2036^ | 141 | 122 | 0,00 |
| | | 852 | 0,02 |
| | **AKTIEN** | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Pinnacle Agriculture Holdings LLC** | | | |
| 3,000 (h) | 885.169 | 415 | 0,01 |
| Summe USA | | 2.163.640 | 57,19 |
| | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (j)** | | | |
| | | 345.751 | 9,14 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 345.751 | 9,14 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | 25.201.230 | 252.390 | 6,67 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 3.767.633** | **99,59** |

## 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**

### VERKAUFSOPTIONEN

#### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 124,000 | 26.07.2019 | 200 | $ (47) | $ (3) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 127,000 | 26.07.2019 | 200 | (72) | (244) | (0,01) |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 125,500 | 26.07.2019 | 165 | (49) | (8) | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 126,500 | 26.07.2019 | 130 | (32) | (18) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note 2019 August Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 295 | (79) | (78) | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note August 2019 Futures | 116,750 | 26.07.2019 | 315 | (61) | (12) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note August 2019 Futures | 118,250 | 26.07.2019 | 315 | (64) | (116) | 0,00 |
| | | | | $ (404) | $ (479) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (479)** | **(0,01)** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-30 5-Year Index | 5,000 % | 20.06.2023 | $ 19.400 | $ 290 | 0,01 |
| CDX.HY-31 5-Year Index | 5,000 | 20.12.2023 | 111.550 | 3.374 | 0,08 |
| CDX.HY-32 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2024 | 45.000 | 233 | 0,01 |
| | | | | $ 3.897 | 0,10 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | **$ 3.897** | **0,10** |

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

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

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

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

### 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | $ 4.400 | 20.09.2019 | $ (31) | $ 197 | $ 166 | 0,00 |
| BPS | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 1.600 | 20.12.2019 | (10) | 25 | 15 | 0,00 |
| BRC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 5.000 | 20.09.2019 | (31) | 80 | 49 | 0,00 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 15.700 | 20.12.2019 | (102) | 238 | 136 | 0,00 |
| GST | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 23.300 | 20.09.2019 | (68) | 828 | 760 | 0,02 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 10.000 | 20.12.2019 | (3) | (7) | (10) | 0,00 |
| JPM | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 20.000 | 20.09.2019 | (121) | 1.053 | 932 | 0,03 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 60.000 | 20.09.2019 | (338) | 2.071 | 1.733 | 0,05 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 5.000 | 20.12.2019 | (29) | 129 | 100 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (733) | $ 4.614 | $ 3.881 | 0,10 |

### DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ 340.301 | € 299.455 | $ 719 | $ 0 | $ 719 | 0,02 |
| | 08/2019 | € 299.455 | $ 341.168 | 0 | (723) | (723) | (0,02) |
| BPS | 07/2019 | $ 1.767 | CHF 1.760 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 07/2019 | 1.776 | € 1.574 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 07/2019 | 76.256 | £ 60.108 | 249 | (6) | 243 | 0,01 |
| | 08/2019 | £ 57.297 | $ 72.784 | 0 | (251) | (251) | (0,01) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | 07/2019 | € 305.293 | $ 341.436 | $ 1 | $ (6.233) | $ (6.232) | (0,16) |
| CBK | 07/2019 | 95 | 108 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | $ 1.129 | € 995 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | € 21.162 | $ 24.061 | 0 | (39) | (39) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ 20 | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 232 | £ 183 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | 44 | SGD 60 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | 3.696 | € 3.269 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 07/2019 | 3.826 | £ 3.038 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | £ 32 | $ 41 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 63.146 | 79.923 | 0 | (442) | (442) | (0,01) |
| | | | | $ 1.095 | $ (7.694) | $ (6.599) | (0,17) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend und Institutional CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ 17.736 | CHF 17.790 | $ 510 | $ 0 | $ 510 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | 41 | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF 18.396 | $ 18.774 | 0 | (94) | (94) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 17.697 | CHF 17.736 | 493 | 0 | 493 | 0,01 |
| | 08/2019 | 18.084 | 17.657 | 79 | 0 | 79 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | CHF 811 | $ 833 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 17.756 | CHF 17.872 | 574 | 0 | 574 | 0,02 |
| HUS | 07/2019 | CHF 17.668 | $ 18.084 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 18.136 | CHF 17.668 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CHF 105 | $ 106 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | $ 20 | CHF 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 1.694 | $ (133) | $ 1.561 | 0,04 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 417.374 | $ 474.304 | $ 0 | $ (1.002) | $ (1.002) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ 475.513 | € 417.374 | 1.008 | 0 | 1.008 | 0,03 |
| BPS | 07/2019 | € 418.483 | $ 475.807 | 0 | (762) | (762) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ 18.884 | € 16.614 | 41 | (5) | 36 | 0,00 |
| | 08/2019 | 475.765 | 417.374 | 756 | 0 | 756 | 0,02 |
| BRC | 07/2019 | 445.993 | 398.752 | 8.106 | 0 | 8.106 | 0,22 |
| CBK | 07/2019 | € 453.817 | $ 515.776 | 0 | (1.030) | (1.030) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ 43.629 | € 38.375 | 101 | (30) | 71 | 0,00 |
| | 08/2019 | 475.556 | 417.374 | 965 | 0 | 965 | 0,03 |
| GLM | 07/2019 | 456.087 | 408.578 | 9.202 | 0 | 9.202 | 0,24 |
| MYI | 07/2019 | 445.885 | 398.752 | 8.214 | 0 | 8.214 | 0,22 |
| RBC | 07/2019 | 4.505 | 3.972 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | 12.847 | 11.356 | 85 | 0 | 85 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € 17.384 | $ 19.530 | 0 | (267) | (267) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 1.199 | € 1.059 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € 2.818 | $ 3.187 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 9.327 | € 8.351 | 184 | 0 | 184 | 0,01 |
| | | | | $ 28.687 | $ (3.118) | $ 25.569 | 0,68 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | £ 216 | $ 272 | $ 0 | $ (3) | $ (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 7.179 | £ 5.666 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 179.140 | $ 227.214 | 0 | (777) | (777) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ 4.366 | £ 3.437 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | 226.848 | 178.579 | 783 | 0 | 783 | 0,02 |
| CBK | 07/2019 | £ 189.396 | $ 240.698 | 28 | (374) | (346) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 228.533 | £ 180.367 | 1.020 | 0 | 1.020 | 0,03 |
| | 08/2019 | 226.557 | 178.035 | 380 | 0 | 380 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | £ 4.562 | $ 5.767 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 230 | £ 181 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | £ 10.965 | $ 13.920 | 14 | (49) | (35) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | $ 228.290 | £ 180.367 | 1.264 | (1) | 1.263 | 0,03 |
| SSB | 07/2019 | 229.659 | 181.743 | 1.647 | (1) | 1.646 | 0,04 |
| | | | | $ 5.177 | $ (1.245) | $ 3.932 | 0,10 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Class E SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währu | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 891 | SGD | 1.228 | $ 17 | $ 0 | $ 17 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | SGD | 1.124 | $ | 830 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 880 | SGD | 1.214 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 833 | | 1.128 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 877 | | 1.204 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| DUB | 07/2019 | | 876 | | 1.206 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | SGD | 1.127 | $ | 832 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 834 | SGD | 1.129 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SGD | 1.075 | $ | 792 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 365 | SGD | 499 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | SGD | 34 | $ | 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 914 | SGD | 1.240 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | SGD | 108 | $ | 79 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | | 11 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 1.294 | | 955 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | | 12 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 698 | SGD | 943 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | SGD | 173 | $ | 126 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4 | SGD | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | SGD | 455 | $ | 334 | 0 | (3 | (3) | 0,00 |
| | | | | | | $ 71 | $ (11) | $ 60 | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 28.404** | **0,75** |
| **Summe Anlagen** | **$ 3.799.455** | **100,43** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (16.162)** | **(0,43)** |
| **Nettovermögen** | **$ 3.783.293** | **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) 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 | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Afren PLC 0,112 % fällig am 25.04.2049 | 30.04.2015 | $ 4.820 | $ 622 | 0,02 |
| Bibby Offshore Services PLC | 15.01.2018 - 17.01.2018 | 1.700 | 2.323 | 0,06 |
| NVHL S.A. 'A' | 15.03.2012 | 162 | 58 | 0,00 |
| NVHL S.A. 'B' | 15.03.2012 | 162 | 58 | 0,00 |
| NVHL S.A. 'C' | 15.03.2012 | 162 | 58 | 0,00 |
| NVHL S.A. 'D' | 15.03.2012 | 162 | 58 | 0,00 |
| NVHL S.A. 'E' | 15.03.2012 | 162 | 58 | 0,00 |
| NVHL S.A. 'F' | 15.03.2012 | 162 | 59 | 0,01 |
| NVHL S.A. 'G | 15.03.2012 | 162 | 59 | 0,01 |
| NVHL S.A. 'H' | 15.03.2012 | 162 | 59 | 0,00 |
| NVHL S.A. 'I' | 15.03.2012 | 162 | 59 | 0,00 |
| NVHL S.A. 'J' | 15.03.2012 | 162 | 59 | 0,00 |
| Pinnacle Agriculture Holdings LLC 3,000 % | 10.03.2017 | 885 | 415 | 0,01 |
| | | $ 9.025 | $ 3.945 | 0,11 |

**(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 28.049 und Barmittel in Höhe von USD 1.295 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 844 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 9.537 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 2,550 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 10.900 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 | $ (11.144) | $ 10.900 | $ 10.902 | 0,29 |
| FICC | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 11.651 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | (11.887) | 11.651 | 11.653 | 0,31 |
| JPS | 2,800 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 250.000 | U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.11.2045 | (255.075) | 250.000 | 250.058 | 6,61 |
| RVM | 2,800 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 25.000 | U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 31.05.2023 | (25.518) | 25.000 | 25.006 | 0,66 |
| SAL | 2,600 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 48.200 | U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.03.2025 | (49.228) | 48.200 | 48.210 | 1,27 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (352.852)** | **$ 345.751** | **$ 345.829** | **9,14** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 375.231 | $ 3.388.223 | $ 4.179 | $ 3.767.633 |
| Finanzderivate[3] | (479) | 32.301 | 0 | 31.822 |
| **Summen** | **$ 374.752** | **$ 3.420.524** | **$ 4.179** | **$ 3.799.455** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 296.141 | $ 2.856.607 | $ 4.111 | $ 3.156.859 |
| Finanzderivate[3] | (599) | (2.130) | 0 | (2.729) |
| **Summen** | **$ 295.542** | **$ 2.854.477** | **$ 4.111** | **$ 3.154.130** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Verbindlich-keiten aus Pensions-geschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BCY | 0,875 % | 24.12.2018 | TBD[1] | € (3.560) | $ (3.576) | (0,09) |
| | 2,050 | 24.12.2018 | TBD[1] | (1.647) | (1.665) | (0,04) |
| | 2,300 | 28.01.2019 | TBD[1] | (1.898) | (1.917) | (0,05) |
| BPS | (2,500) | 07.11.2018 | TBD[1] | (220) | (246) | (0,01) |
| BRC | (1,750) | 12.04.2019 | TBD[1] | (1.002) | (1.137) | (0,03) |
| | (0,500) | 31.01.2019 | TBD[1] | $ (1.806) | (1.802) | (0,05) |
| | (0,500) | 02.05.2019 | TBD[1] | (2.811) | (2.809) | (0,07) |
| | 0,000 | 13.12.2018 | TBD[1] | (2.361) | (2.361) | (0,06) |
| | 0,000 | 07.02.2019 | TBD[1] | (2.937) | (2.937) | (0,08) |
| | 1,000 | 28.06.2019 | TBD[1] | (2.850) | (2.850) | (0,08) |
| | 2,350 | 24.12.2018 | TBD[1] | (5.099) | (5.162) | (0,14) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (26.462)** | **(0,70)** |

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 724 | $ (610) | $ 114 |
| BPS | 123 | 0 | 123 |
| BRC | 2.059 | (1.870) | 189 |
| CBK | 1.551 | (790) | 761 |
| DUB | 15 | 0 | 15 |
| GLM | 9.741 | (9.120) | 621 |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| GST | $ 750 | $ (830) | $ (80) |
| HUS | (68) | 0 | (68) |
| JPM | 2.832 | (2.540) | 292 |
| MYI | 8.212 | (7.480) | 732 |
| RBC | 18 | 0 | 18 |
| RYL | 84 | (150) | (66) |
| SCX | 559 | (70) | 489 |
| SSB | 1.807 | (810) | 997 |
| UAG | (3) | 0 | (3) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 49,73 | 51,48 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 40,72 | 48,56 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 9,14 | 0,05 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,01) | (0,02) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,10 | (0,05) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,75 | (0,01) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,70) | (2,10) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 0,00 | 0,10 |
| Bermuda | 0,35 | 0,46 |
| Kanada | 3,26 | 4,45 |
| Cayman-Inseln | 1,81 | 2,25 |
| Dänemark | 0,41 | 0,45 |
| Frankreich | 1,62 | 2,32 |
| Deutschland | 2,37 | 2,56 |
| Irland | 3,25 | 4,11 |
| Italien | 2,16 | 2,76 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,30 | 0,37 |
| Luxemburg | 2,25 | 3,01 |
| Multinational | 0,89 | 0,47 |
| Niederlande | 3,38 | 3,53 |
| Singapur | 0,13 | 0,15 |
| Spanien | 0,16 | 0,00 |
| Schweden | 0,18 | 0,33 |
| Großbritannien | 4,07 | 4,69 |
| Vereinigte Staaten | 57,19 | 62,25 |
| Kurzfristige Instrumente | 9,14 | 0,05 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 6,67 | 5,78 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | (0,02) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,10 | (0,05) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,10 | (0,04) |
| Devisenterminkontrakte | (0,17) | (0,01) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,82 | 0,04 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (0,43) | (0,01) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Santander Mexico S.A.** | | | | |
| 25,500 % fällig am 17.07.2019 | ARS | 727.098 | $ 16.600 | 0,08 |
| **HSBC Bank Argentina S.A.** | | | | |
| 25,250 % fällig am 27.09.2019 | | 282.084 | 6.050 | 0,03 |
| | | | 22.650 | 0,11 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 3,380 % fällig am 31.12.2038 | € | 1.300 | 846 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 31.12.2038 | $ | 15.300 | 8.989 | 0,05 |
| 6,875 % fällig am 26.01.2027 | | 4.240 | 3.412 | 0,02 |
| 53,892 % fällig am 01.03.2020 (a) | ARS | 8.200 | 187 | 0,00 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 262.407 | 6.043 | 0,03 |
| | | | 19.477 | 0,10 |
| Summe Argentinien | | | 42.127 | 0,21 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Driver Australia Five Trust** | | | | |
| 2,810 % fällig am 21.07.2026 | AUD | 14.152 | 9.920 | 0,05 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **APT Pipelines Ltd.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 23.03.2025 | $ | 1.553 | 1.630 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 15.07.2027 | | 1.400 | 1.470 | 0,01 |
| **Boral Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.11.2022 | | 5.943 | 5.945 | 0,03 |
| **Commonwealth Bank of Australia** | | | | |
| 2,400 % fällig am 02.11.2020 | | 12.750 | 12.774 | 0,06 |
| **GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 30.09.2026 | | 300 | 300 | 0,00 |
| **Optus Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.06.2029 | € | 15.800 | 18.259 | 0,09 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 23.09.2020 | $ | 3.092 | 3.155 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 22.03.2028 | | 16.400 | 16.758 | 0,08 |
| **Santos Finance Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 14.09.2027 | | 7.800 | 7.704 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 13.03.2029 | | 6.700 | 7.013 | 0,04 |
| **Scentre Group Trust** | | | | |
| 3,750 % fällig am 23.03.2027 | | 500 | 515 | 0,00 |
| **SGSP Australia Assets Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 09.04.2023 | | 14.000 | 14.293 | 0,07 |
| **Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 22.02.2021 | | 5.560 | 5.784 | 0,03 |
| **Telstra Corp. Ltd.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 12.10.2021 | | 3.905 | 4.110 | 0,02 |
| **Virgin Australia Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,000 % fällig am 23.04.2025 | | 43 | 44 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 23.04.2022 | | 281 | 286 | 0,00 |
| **Volkswagen Financial Services Australia Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 13.04.2021 | AUD | 12.200 | 8.723 | 0,04 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | $ | 8.200 | 8.216 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 04.03.2029 | | 18.900 | 19.988 | 0,10 |
| 4,600 % fällig am 10.05.2021 | | 3.350 | 3.453 | 0,02 |
| | | | 140.420 | 0,70 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Progress Trust** | | | | |
| 2,845 % fällig am 18.06.2044 | AUD | 8.200 | 5.811 | 0,03 |
| **Westpac Securitisation Trust** | | | | |
| 2,560 % fällig am 20.01.2041 | | 221 | 155 | 0,00 |
| | | | 5.966 | 0,03 |
| Summe Australien | | | 156.306 | 0,78 |
| **AUSTRIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.10.2025 (g)(i) | € | 8.000 | $ 9.639 | 0,05 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Anheuser-Busch InBev S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 07.03.2025 | £ | 6.200 | 7.920 | 0,04 |
| 2,250 % fällig am 24.05.2029 | | 10.500 | 13.316 | 0,07 |
| **Groupe Bruxelles Lambert S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 19.06.2025 | € | 6.500 | 7.729 | 0,04 |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (g)(i) | | 36.200 | 40.458 | 0,20 |
| Summe Belgien | | | 69.423 | 0,35 |
| **BERMUDA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **MAPS Ltd.** | | | | |
| 4,212 % fällig am 15.05.2043 | $ | 10.377 | 10.646 | 0,06 |
| **S-Jets Ltd.** | | | | |
| 3,967 % fällig am 15.08.2042 | | 19.267 | 19.687 | 0,10 |
| **START Ireland** | | | | |
| 4,089 % fällig am 15.03.2044 | | 6.384 | 6.435 | 0,03 |
| | | | 36.768 | 0,19 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bacardi Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2023 | € | 3.630 | 4.425 | 0,02 |
| 4,450 % fällig am 15.05.2025 | $ | 18.200 | 19.363 | 0,10 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2021 | | 1.600 | 1.637 | 0,01 |
| 4,700 % fällig am 15.05.2028 | | 31.700 | 33.943 | 0,17 |
| **China Resources Gas Group Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 05.04.2022 | | 14.000 | 14.658 | 0,07 |
| **IHS Markit Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.05.2024 | | 900 | 929 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 01.05.2029 | | 9.800 | 10.300 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 15.02.2025 | | 2.825 | 3.037 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 01.08.2028 | | 4.500 | 4.921 | 0,03 |
| **Sompo International Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 15.10.2022 | | 4.500 | 4.680 | 0,02 |
| **VOC Escrow Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2028 | | 2.200 | 2.241 | 0,01 |
| | | | 100.134 | 0,50 |
| Summe Bermuda | | | 136.902 | 0,69 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 31.01.2023 | | 22.677 | 23.612 | 0,12 |
| **Braskem Finance Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 02.05.2022 | | 6.200 | 6.540 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 15.04.2021 | | 2.200 | 2.311 | 0,01 |
| 6,450 % fällig am 03.02.2024 | | 1.800 | 1.994 | 0,01 |
| **Braskem Netherlands Finance BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 10.01.2023 | | 21.900 | 22.048 | 0,11 |
| 4,500 % fällig am 10.01.2028 | | 4.300 | 4.366 | 0,02 |
| **CSN Resources S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 21.07.2020 | | 5.200 | 5.357 | 0,03 |
| 7,625 % fällig am 13.02.2023 | | 2.200 | 2.329 | 0,01 |
| 7,625 % fällig am 17.04.2026 | | 3.600 | 3.828 | 0,02 |
| **Embraer Netherlands Finance BV** | | | | |
| 5,050 % fällig am 15.06.2025 | | 5.400 | 5.842 | 0,03 |
| **Globo Comunicacao e Participacoes S.A.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 11.04.2022 | | 3.434 | 3.548 | 0,02 |
| **Oi S.A. (10,000 % bar)** | | | | |
| 10,000 % fällig am 27.07.2025 (c)(j) | | 5.300 | 5.499 | 0,03 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 3.665 | 3.935 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | £ | 200 | 288 | 0,00 |
| 6,625 % fällig am 16.01.2034 | | 150 | 213 | 0,00 |
| **Suzano Austria GmbH** | | | | |
| 7,000 % fällig am 16.03.2047 | $ | 7.600 | 8.664 | 0,04 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 11.01.2022 | $ | 2.546 | $ 2.636 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 10.08.2026 | | 32.489 | 37.068 | 0,19 |
| Summe Brasilien | | | 140.078 | 0,70 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.09.2028 | | 3.778 | 3.902 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 15.06.2029 | | 3.592 | 3.764 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 15.11.2026 | | 805 | 848 | 0,01 |
| **Alimentation Couche-Tard, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 26.07.2022 | | 4.000 | 4.009 | 0,02 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.01.2023 | | 3.300 | 3.354 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 01.12.2024 | | 1.300 | 1.329 | 0,01 |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2024 | | 22.750 | 23.927 | 0,12 |
| 4,700 % fällig am 20.09.2047 | | 2.400 | 2.513 | 0,01 |
| 4,850 % fällig am 29.03.2029 | | 11.500 | 12.589 | 0,06 |
| **Cenovus Energy, Inc.** | | | | |
| 5,700 % fällig am 15.10.2019 | | 8.077 | 8.140 | 0,04 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 3,110 % fällig am 15.06.2020 | | 20.200 | 20.258 | 0,10 |
| **Encana Corp.** | | | | |
| 7,200 % fällig am 01.11.2031 | | 200 | 255 | 0,00 |
| 7,375 % fällig am 01.11.2031 | | 3.965 | 5.091 | 0,03 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 24.600 | 30.066 | 0,15 |
| **Frontera Energy Corp.** | | | | |
| 9,700 % fällig am 25.06.2023 | $ | 1.800 | 1.924 | 0,01 |
| **Masonite International Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.09.2026 | | 5.800 | 5.988 | 0,03 |
| **Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust** | | | | |
| 3,875 % fällig am 20.03.2027 | | 11.700 | 12.334 | 0,06 |
| 4,125 % fällig am 01.02.2029 | | 6.000 | 6.527 | 0,03 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 2,100 % fällig am 14.10.2020 | | 2.075 | 2.076 | 0,01 |
| **West Fraser Timber Co. Ltd.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.10.2024 | | 6.000 | 6.231 | 0,03 |
| **WestJet Airlines Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 16.06.2021 | | 10.593 | 10.656 | 0,05 |
| | | | 165.781 | 0,83 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canadian Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2048 | CAD | 500 | 477 | 0,00 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 2,600 % fällig am 02.06.2025 | | 161.500 | 128.287 | 0,64 |
| 3,150 % fällig am 02.06.2022 | | 14.750 | 11.751 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 02.06.2024 | | 11.400 | 9.404 | 0,05 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 26.550 | 21.511 | 0,11 |
| | | | 171.430 | 0,86 |
| Summe Kanada | | | 337.211 | 1,69 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd.** | | | | |
| 4,213 % fällig am 16.12.2041 | $ | 7.641 | 7.881 | 0,04 |
| **ECAF Ltd.** | | | | |
| 4,947 % fällig am 15.06.2040 | | 12.759 | 13.150 | 0,07 |
| **KDAC Aviation Finance Ltd.** | | | | |
| 4,212 % fällig am 15.12.2042 | | 7.329 | 7.518 | 0,04 |
| **METAL LLC** | | | | |
| 4,581 % fällig am 15.10.2042 | | 20.436 | 20.667 | 0,10 |
| **Sapphire Aviation Finance Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.03.2040 | | 16.366 | 16.606 | 0,08 |
| **Sprite Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.12.2037 | | 11.035 | 11.327 | 0,06 |
| **Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.** | | | | |
| 4,212 % fällig am 17.05.2032 | | 4.606 | 4.739 | 0,02 |
| | | | 81.888 | 0,41 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **21Vianet Group, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2021 | $ | 12.200 | $ 12.586 | 0,06 |
| **Ambac LSNI LLC** | | | | |
| 7,319 % fällig am 12.02.2023 | | 15.923 | 16.221 | 0,08 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | | 1.200 | 1.282 | 0,01 |
| **Baidu, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.06.2020 | | 19.200 | 19.286 | 0,10 |
| 4,375 % fällig am 14.05.2024 | | 13.700 | 14.528 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 14.11.2028 | | 3.000 | 3.289 | 0,02 |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 6,250 % fällig am 28.06.2021 | | 14.800 | 14.234 | 0,07 |
| 7,000 % fällig am 23.03.2020 | | 41.100 | 41.562 | 0,21 |
| 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 6.400 | 6.186 | 0,03 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 04.04.2021 | | 11.900 | 12.099 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 09.03.2020 | | 18.500 | 18.860 | 0,09 |
| **Dwr Cymru Financing Ltd.** | | | | |
| 3,514 % fällig am 31.03.2030 | £ | 25 | 48 | 0,00 |
| **Geely Automobile Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 25.01.2023 | $ | 14.600 | 14.654 | 0,07 |
| **Health and Happiness International Holdings Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 21.06.2021 | | 3.006 | 3.077 | 0,02 |
| **KSA Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,894 % fällig am 20.04.2022 | | 19.100 | 19.339 | 0,10 |
| **Lunar Funding Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 09.06.2027 | £ | 50 | 80 | 0,00 |
| **MAF Global Securities Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 07.05.2024 | $ | 8.100 | 8.479 | 0,04 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 51.450 | 51.240 | 0,26 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2026 | | 18.000 | 18.039 | 0,09 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2024 | | 25.000 | 25.681 | 0,13 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 4.800 | 4.938 | 0,02 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | | 1.878 | 1.869 | 0,01 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 26.800 | 27.729 | 0,14 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 8.959 | 9.481 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | | 2.250 | 2.428 | 0,01 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 29.04.2020 | | 3.000 | 3.005 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | | 27.600 | 28.161 | 0,14 |
| 3,576 % fällig am 02.05.2022 | | 28.500 | 28.714 | 0,14 |
| 3,872 % fällig am 31.05.2021 | | 48.700 | 49.371 | 0,25 |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 2.000 | 2.005 | 0,01 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | | 500 | 527 | 0,00 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 10.100 | 10.852 | 0,05 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 11.500 | 12.519 | 0,06 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 08.08.2020 | | 4.100 | 4.154 | 0,02 |
| 8,375 % fällig am 15.01.2021 | | 26.600 | 27.548 | 0,14 |
| 8,625 % fällig am 27.07.2020 | | 10.500 | 10.828 | 0,05 |
| **Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 23.01.2023 | | 9.481 | 9.527 | 0,05 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,280 % fällig am 11.04.2024 | | 2.000 | 2.044 | 0,01 |
| 3,491 % fällig am 11.04.2024 | | 12.200 | 12.211 | 0,06 |
| 3,575 % fällig am 11.04.2026 | | 13.600 | 13.954 | 0,07 |
| 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 3.000 | 3.066 | 0,02 |
| 3,975 % fällig am 11.04.2029 | | 25.600 | 26.782 | 0,13 |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** | | | | |
| 7,030 % fällig am 28.01.2029 | £ | 271 | 426 | 0,00 |
| **Transocean Guardian Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2024 | $ | 13.325 | 13.608 | 0,07 |
| **Transocean Phoenix Ltd.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.10.2024 | | 2.250 | 2.413 | 0,01 |
| **Transocean Pontus Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.08.2025 | | 2.268 | 2.347 | 0,01 |
| **Transocean Proteus Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.12.2024 | | 1.275 | 1.321 | 0,01 |
| **Transocean, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 9.800 | 9.322 | 0,05 |
| 9,000 % fällig am 15.07.2023 | | 3.900 | 4.168 | 0,02 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | $ | 40.400 | $ 39.390 | 0,20 |
| **XLIT Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 31.03.2025 | | 8.696 | 9.400 | 0,05 |
| **Yingde Gases Investment Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 19.01.2023 | | 3.000 | 3.054 | 0,02 |
| | | | 677.932 | 3,40 |
| Summe Cayman Inseln | | | 759.820 | 3,81 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 3,380 % fällig am 25.07.2020 | | 15.000 | 15.038 | 0,07 |
| **Celeo Redes Operacion Chile S.A.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 22.06.2047 | | 3.527 | 3.677 | 0,02 |
| **Corp. Nacional del Cobre de Chile** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.08.2027 | | 11.700 | 12.142 | 0,06 |
| **Latam Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.08.2029 | | 3.450 | 3.500 | 0,02 |
| Summe Chile | | | 34.357 | 0,17 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Amber Circle Funding Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 04.12.2022 | | 35.825 | 36.397 | 0,18 |
| **CNOOC Curtis Funding Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 03.10.2023 | | 1.800 | 1.926 | 0,01 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 0,240 % fällig am 12.10.2020 | € | 11.500 | 13.097 | 0,07 |
| 3,310 % fällig am 08.11.2020 | $ | 16.650 | 16.686 | 0,08 |
| 3,374 % fällig am 12.10.2020 | | 7.700 | 7.711 | 0,04 |
| **SF Holding Investment Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 26.07.2023 | | 5.900 | 6.153 | 0,03 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 29.09.2019 | | 50.200 | 50.130 | 0,25 |
| 2,500 % fällig am 13.09.2022 | | 61.000 | 60.779 | 0,31 |
| 3,900 % fällig am 17.05.2022 | | 300 | 310 | 0,00 |
| **State Grid Overseas Investment Ltd.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 02.05.2030 | € | 8.100 | 10.279 | 0,05 |
| 2,750 % fällig am 04.05.2022 | $ | 3.000 | 3.012 | 0,02 |
| | | | 206.480 | 1,04 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **China Development Bank** | | | | |
| 0,375 % fällig am 16.11.2021 | € | 14.100 | 16.241 | 0,08 |
| Summe China | | | 222.721 | 1,12 |
| **CURACAO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Teva Pharmaceutical Finance BV** | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | $ | 6.006 | 5.821 | 0,03 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Co. BV** | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | | 12.030 | 11.624 | 0,06 |
| Summe Curacao | | | 17.445 | 0,09 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.03.2026 | € | 11.000 | 12.850 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 22.09.2024 | $ | 4.500 | 4.562 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 28.09.2025 | | 2.000 | 2.015 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 20.06.2029 | | 3.800 | 3.862 | 0,02 |
| **Danske Bank A/S** | | | | |
| 5,875 % fällig am 06.04.2022 (g)(i) | € | 12.900 | 15.541 | 0,08 |
| **TDC A/S** | | | | |
| 6,875 % fällig am 23.02.2023 | £ | 559 | 813 | 0,00 |
| Summe Dänemark | | | 39.643 | 0,20 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ahlstrom-Munksjo Oyj** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.06.2022 | € | 9.000 | 10.410 | 0,05 |
| **Nordea Bank Abp** | | | | |
| 2,995 % fällig am 29.05.2020 | $ | 13.900 | $ 13.949 | 0,07 |
| 6,625 % fällig am 26.03.2026 (g)(i) | | 3.000 | 3.168 | 0,02 |
| **Sampo OYJ** | | | | |
| 3,375 % fällig am 23.05.2049 | € | 3.100 | 3.784 | 0,02 |
| Summe Finnland | | | 31.311 | 0,16 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Altareit S.C.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 02.07.2025 | | 22.800 | 27.110 | 0,14 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.05.2024 | $ | 292 | 302 | 0,00 |
| 7,375 % fällig am 01.05.2026 | | 4.800 | 4.932 | 0,02 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | |
| 3,552 % fällig am 20.07.2023 | | 7.850 | 7.916 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 20.07.2023 | | 2.650 | 2.780 | 0,01 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 23.05.2022 | | 500 | 505 | 0,00 |
| 3,375 % fällig am 09.01.2025 | | 9.900 | 10.080 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 16.11.2027 | | 18.200 | 18.641 | 0,09 |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 37.000 | 39.721 | 0,20 |
| 5,198 % fällig am 10.01.2030 (k) | | 33.900 | 38.855 | 0,19 |
| 7,000 % fällig am 16.08.2028 (g)(i) | | 4.300 | 4.594 | 0,02 |
| 7,375 % fällig am 19.08.2025 (g)(i) | | 10.300 | 11.455 | 0,06 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 02.12.2021 | | 7.700 | 7.774 | 0,04 |
| 3,743 % fällig am 22.05.2022 | | 14.300 | 14.452 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 15.04.2024 | | 3.000 | 3.195 | 0,02 |
| **Bureau Veritas S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 06.01.2025 | € | 16.300 | 19.307 | 0,10 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 24.04.2023 | $ | 13.550 | 14.074 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 23.06.2026 (g)(i) | £ | 10.438 | 15.111 | 0,08 |
| **Danone S.A.** | | | | |
| 1,691 % fällig am 30.10.2019 | $ | 7.295 | 7.276 | 0,04 |
| 2,589 % fällig am 02.11.2023 | | 10.000 | 10.056 | 0,05 |
| **Eutelsat S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 02.10.2025 | € | 5.000 | 5.869 | 0,03 |
| **Ingenico Group S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 13.09.2024 | | 10.000 | 11.359 | 0,06 |
| **Pernod Ricard S.A.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.01.2022 | $ | 10.325 | 10.808 | 0,05 |
| **Safran S.A.** | | | | |
| 0,227 % fällig am 28.06.2021 | € | 10.900 | 12.411 | 0,06 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 31.05.2024 | | 12.800 | 15.072 | 0,08 |
| 2,375 % fällig am 25.11.2022 | | 2.800 | 3.398 | 0,02 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.04.2028 (g)(i) | $ | 11.950 | 11.850 | 0,06 |
| **TDF Infrastructure S.A.S.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 07.04.2026 | € | 21.600 | 26.074 | 0,13 |
| 2,875 % fällig am 19.10.2022 | | 3.700 | 4.485 | 0,02 |
| **Teleperformance** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.07.2025 | | 9.900 | 11.881 | 0,06 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | |
| 1,289 % fällig am 30.01.2023 | | 6.500 | 7.523 | 0,04 |
| | | | 378.866 | 1,90 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Numericable Group S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 31.07.2025 | | 4.386 | 4.842 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 31.01.2026 | | 3.990 | 4.405 | 0,02 |
| | | | 9.247 | 0,05 |
| Summe Frankreich | | | 388.113 | 1,95 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,180 % fällig am 07.12.2020 | | 1.200 | 1.351 | 0,01 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 2.600 | 2.987 | 0,02 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2020 | £ | 10.200 | 12.976 | 0,07 |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | € | 10.000 | 11.562 | 0,06 |
| 3,150 % fällig am 22.01.2021 | $ | 20.700 | 20.551 | 0,10 |
| 3,300 % fällig am 16.11.2022 | | 5.700 | 5.607 | 0,03 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,715 % fällig am 16.11.2022 | $ | 29.200 | $ 28.228 | 0,14 |
| 3,855 % fällig am 04.02.2021 | | 3.000 | 2.976 | 0,02 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 98.100 | 99.485 | 0,50 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (c) | € | 39.700 | 45.930 | 0,23 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | |
| 0,375 % fällig am 15.03.2023 | | 4.900 | 5.767 | 0,03 |
| **ProSiebenSat.1 Media SE** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2021 | | 8.700 | 10.272 | 0,05 |
| **TLG Immobilien AG** | | | | |
| 1,500 % fällig am 28.05.2026 | | 14.500 | 16.528 | 0,08 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,102 % fällig am 15.06.2021 | | 2.200 | 2.503 | 0,01 |
| 0,377 % fällig am 08.12.2021 | | 13.000 | 14.860 | 0,07 |
| 0,625 % fällig am 08.09.2021 | | 10.100 | 11.621 | 0,06 |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 13.400 | 16.011 | 0,08 |
| 2,500 % fällig am 31.07.2026 | | 7.100 | 8.767 | 0,04 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,489 % fällig am 15.02.2021 | | 13.300 | 15.233 | 0,08 |
| 0,625 % fällig am 01.04.2022 | | 6.000 | 6.896 | 0,03 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2024 | | 9.800 | 11.506 | 0,06 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 0,250 % fällig am 16.02.2021 | | 19.400 | 22.163 | 0,11 |
| 0,500 % fällig am 20.06.2022 | | 12.500 | 14.302 | 0,07 |
| 1,000 % fällig am 16.02.2023 | | 200 | 232 | 0,00 |
| 1,125 % fällig am 04.04.2024 | | 11.100 | 12.834 | 0,06 |
| 1,375 % fällig am 20.01.2025 | | 4.600 | 5.379 | 0,03 |
| 1,500 % fällig am 19.06.2026 | | 14.200 | 16.360 | 0,08 |
| | | | 422.887 | 2,12 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.12.2019 (e) | | 4.300 | 4.911 | 0,02 |
| Summe Deutschland | | | 427.798 | 2,14 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 14.04.2022 | | 2.200 | 2.593 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 26.03.2020 | $ | 2.325 | 2.329 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 14.400 | 15.050 | 0,08 |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 28.925 | 29.998 | 0,15 |
| 4,891 % fällig am 16.04.2021 | | 10.000 | 10.322 | 0,05 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | | 18.855 | 19.649 | 0,10 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 20.06.2022 | € | 17.900 | 21.642 | 0,11 |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | | 7.200 | 8.728 | 0,04 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | 110.311 | 0,55 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AIA Group Ltd.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 09.04.2029 | $ | 2.900 | 3.031 | 0,02 |
| **China Shenhua Overseas Capital Co. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 20.01.2020 | | 2.800 | 2.805 | 0,01 |
| **CMHI Finance BVI Co. Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 06.08.2023 | | 26.600 | 28.043 | 0,14 |
| **CNOOC Finance Australia Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.05.2020 | | 26.810 | 26.861 | 0,13 |
| **CNOOC Finance Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 26.01.2021 | | 15.050 | 15.457 | 0,08 |
| **Eastern Creation Investment Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.09.2020 | | 6.100 | 6.105 | 0,03 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.05.2022 | | 22.000 | 22.246 | 0,11 |
| 3,510 % fällig am 28.06.2021 | | 17.400 | 17.466 | 0,09 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 23.12.2019 | | 31.426 | 31.619 | 0,16 |
| 4,150 % fällig am 18.04.2023 | | 39.300 | 40.389 | 0,20 |
| 4,200 % fällig am 07.06.2024 | | 9.400 | 9.675 | 0,05 |
| | | | 203.697 | 1,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Airport Authority Hong Kong** | | | | |
| 3,450 % fällig am 21.02.2029 | $ | 5.900 | $ 6.271 | 0,03 |
| Summe Hongkong | | | 209.968 | 1,05 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 19.01.2022 | | 8.600 | 8.780 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 30.07.2027 | | 875 | 876 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 03.07.2029 (b) | | 1.300 | 1.321 | 0,01 |
| **Axis Bank Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 21.05.2020 | | 11.600 | 11.626 | 0,06 |
| **ICICI Bank Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 18.03.2020 | | 7.400 | 7.432 | 0,04 |
| **ONGC Videsh Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.07.2019 | | 8.100 | 8.102 | 0,04 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,700 % fällig am 27.02.2022 | | 20.700 | 21.015 | 0,10 |
| 5,950 % fällig am 24.10.2022 | | 17.000 | 17.289 | 0,09 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 3,442 % fällig am 20.01.2020 | | 65.000 | 65.109 | 0,33 |
| Summe Indien | | | 141.550 | 0,71 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank Mandiri Persero Tbk PT** | | | | |
| 3,750 % fällig am 11.04.2024 | | 15.000 | 15.303 | 0,08 |
| **Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT** | | | | |
| 4,625 % fällig am 20.07.2023 | | 24.100 | 25.310 | 0,13 |
| **Bukit Makmur Mandiri Utama PT** | | | | |
| 7,750 % fällig am 13.02.2022 | | 2.000 | 2.073 | 0,01 |
| **Majapahit Holding BV** | | | | |
| 7,750 % fällig am 20.01.2020 | | 7.800 | 8.041 | 0,04 |
| **Perusahaan Listrik Negara PT** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.05.2027 | | 8.600 | 8.798 | 0,04 |
| | | | 59.525 | 0,30 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 2,875 % fällig am 08.07.2021 | € | 2.500 | 3.009 | 0,01 |
| Summe Indonesien | | | 62.534 | 0,31 |
| **IRAK** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Iraq Government International Bond** | | | | |
| 6,752 % fällig am 09.03.2023 | $ | 2.750 | 2.831 | 0,01 |
| **IRLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € | 16.000 | 18.445 | 0,09 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 3,300 % fällig am 23.01.2023 | $ | 3.800 | 3.836 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 26.05.2022 | | 350 | 357 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 15.01.2025 | | 23.200 | 23.352 | 0,12 |
| 3,650 % fällig am 21.07.2027 | | 1.335 | 1.329 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 23.01.2028 | | 4.725 | 4.748 | 0,02 |
| 3,950 % fällig am 01.02.2022 | | 2.521 | 2.595 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 03.04.2026 | | 22.725 | 24.002 | 0,12 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | | 2.450 | 2.527 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 22.546 | 23.123 | 0,12 |
| 4,875 % fällig am 16.01.2024 | | 8.150 | 8.757 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2021 | | 4.571 | 4.796 | 0,02 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 4,263 % fällig am 10.04.2025 | | 15.000 | 15.455 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 12.10.2023 | | 4.500 | 4.734 | 0,02 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (g)(i) | € | 2.300 | 2.770 | 0,01 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | $ | 6.800 | 6.770 | 0,03 |
| 4,418 % fällig am 15.11.2035 | | 9.400 | 9.319 | 0,05 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 31.07.2019 | £ | 500 | 638 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 04.11.2020 | | 400 | 538 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Iberdrola Finance Ireland DAC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 11.09.2019 | $ | 1.150 | $ 1.155 | 0,01 |
| **Novatek OAO via Novatek Finance DAC** | | | | |
| 4,422 % fällig am 13.12.2022 | | 11.800 | 12.110 | 0,06 |
| **Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC** | | | | |
| 3,949 % fällig am 24.04.2023 | | 2.800 | 2.825 | 0,02 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.07.2021 | | 9.600 | 9.600 | 0,05 |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | | 1.500 | 1.519 | 0,01 |
| 3,550 % fällig am 15.04.2024 | | 7.700 | 7.929 | 0,04 |
| 4,125 % fällig am 15.07.2023 | | 7.100 | 7.435 | 0,04 |
| | | | 200.664 | 1,00 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (h)** | | 2.587.040 | 262.559 | 1,32 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **AWAS Aviation Capital Ltd.** | | | | |
| 4,870 % fällig am 03.10.2021 (j) | $ | 29.091 | 29.450 | 0,15 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)** | | 2.327.849 | 24.675 | 0,12 |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (h)** | | 329.257 | 3.833 | 0,02 |
| | | | 28.508 | 0,14 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Lusitano Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.10.2047 | € | 310 | 343 | 0,00 |
| Summe Irland | | | 521.524 | 2,61 |
| **INSEL MAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NE Property BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.05.2023 | | 10.800 | 12.635 | 0,06 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Eni SpA** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.09.2023 | $ | 16.900 | 17.621 | 0,09 |
| 4,750 % fällig am 12.09.2028 | | 10.400 | 11.389 | 0,06 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.01.2023 | | 4.100 | 4.088 | 0,02 |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | | 5.600 | 5.619 | 0,03 |
| 5,710 % fällig am 15.01.2026 | | 17.429 | 17.655 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | | 800 | 842 | 0,00 |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (g)(i) | € | 8.075 | 10.376 | 0,05 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 6,497 % fällig am 14.01.2022 | $ | 10.300 | 10.718 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (g)(i) | € | 43.000 | 51.774 | 0,26 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 76.500 | 87.449 | 0,44 |
| **Wind Tre SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 20.01.2023 | € | 2.300 | 2.645 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 20.01.2024 | | 4.300 | 4.842 | 0,03 |
| | | | 225.018 | 1,13 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **BP Mortgages SRL** | | | | |
| 0,000 % fällig am 20.04.2043 | | 21 | 24 | 0,00 |
| **Mars SRL** | | | | |
| 0,989 % fällig am 25.10.2050 | | 108 | 123 | 0,00 |
| | | | 147 | 0,00 |
| Summe Italien | | | 225.165 | 1,13 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 2,701 % fällig am 16.03.2020 | $ | 1.300 | $ 1.301 | 0,01 |
| **Japan Tobacco, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 13.04.2021 | | 9.880 | 9.796 | 0,05 |
| **Meiji Yasuda Life Insurance Co.** | | | | |
| 5,100 % fällig am 26.04.2048 | | 11.900 | 12.989 | 0,06 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.03.2021 | | 13.452 | 13.586 | 0,07 |
| 2,998 % fällig am 22.02.2022 | | 8.300 | 8.433 | 0,04 |
| 3,370 % fällig am 25.07.2022 | | 23.200 | 23.285 | 0,12 |
| 3,446 % fällig am 26.07.2023 | | 13.200 | 13.230 | 0,07 |
| 3,455 % fällig am 02.03.2023 | | 26.400 | 27.160 | 0,14 |
| 3,510 % fällig am 13.09.2021 | | 24.700 | 24.972 | 0,12 |
| 4,400 % fällig am 01.03.2021 | | 7.279 | 7.451 | 0,04 |
| **Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,652 % fällig am 19.09.2022 | | 6.000 | 6.007 | 0,03 |
| **Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 19.10.2020 | | 5.000 | 5.018 | 0,02 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 1,020 % fällig am 11.10.2023 | € | 3.300 | 3.879 | 0,02 |
| 2,632 % fällig am 12.04.2021 | $ | 10.700 | 10.737 | 0,05 |
| 3,331 % fällig am 11.09.2022 | | 44.100 | 44.368 | 0,22 |
| 3,590 % fällig am 13.09.2021 | | 16.800 | 17.019 | 0,08 |
| **MUFG Bank Ltd.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 05.03.2020 | | 29.700 | 29.682 | 0,15 |
| 2,350 % fällig am 08.09.2019 | | 15.300 | 15.296 | 0,08 |
| 2,750 % fällig am 14.09.2020 | | 16.400 | 16.473 | 0,08 |
| **Nippon Life Insurance Co.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 18.10.2042 | | 17.400 | 18.346 | 0,09 |
| **Nippon Telegraph & Telephone Corp.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 26.02.2020 | | 1.000 | 999 | 0,01 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 21.07.2021 | | 9.250 | 9.174 | 0,05 |
| 2,860 % fällig am 29.06.2020 | | 3.300 | 3.307 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 2,440 % fällig am 18.06.2024 | | 16.400 | 16.565 | 0,08 |
| 2,514 % fällig am 17.01.2020 | | 10.000 | 10.008 | 0,05 |
| 2,911 % fällig am 18.10.2019 | | 4.550 | 4.554 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 0,465 % fällig am 30.05.2024 | € | 8.600 | 9.871 | 0,05 |
| 2,846 % fällig am 11.01.2022 | $ | 1.100 | 1.113 | 0,01 |
| 2,934 % fällig am 09.03.2021 | | 7.100 | 7.167 | 0,04 |
| 3,102 % fällig am 17.01.2023 | | 31.700 | 32.288 | 0,16 |
| 3,384 % fällig am 12.07.2022 | | 7.800 | 7.834 | 0,04 |
| 3,732 % fällig am 19.10.2021 | | 5.500 | 5.580 | 0,03 |
| 4,133 % fällig am 09.03.2021 | | 45.100 | 46.044 | 0,23 |
| **Suntory Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 29.09.2019 | | 3.090 | 3.089 | 0,02 |
| 2,550 % fällig am 28.06.2022 | | 7.000 | 7.001 | 0,03 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | |
| 0,787 % fällig am 21.11.2022 | € | 4.000 | 4.646 | 0,02 |
| 1,125 % fällig am 21.11.2022 | | 6.200 | 7.311 | 0,04 |
| **Toyota Motor Corp.** | | | | |
| 2,157 % fällig am 02.07.2022 (b) | $ | 6.900 | 6.902 | 0,03 |
| Summe Japan | | | 492.481 | 2,47 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 11.500 | 13.397 | 0,07 |
| 2,875 % fällig am 31.07.2043 | | 11.732 | 14.248 | 0,07 |
| 4,249 % fällig am 31.07.2043 | | 5.020 | 6.495 | 0,03 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 200 | 251 | 0,00 |
| **Aptiv PLC** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.03.2029 | $ | 4.000 | 4.219 | 0,02 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 13.400 | 16.438 | 0,08 |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | | 30.556 | 37.312 | 0,19 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 23.05.2022 | | 200 | 240 | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 09.08.2051 | £ | 400 | 503 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 15.07.2023 | $ | 326 | 347 | 0,00 |
| **HSBC Bank Capital Funding Sterling LP** | | | | |
| 5,844 % fällig am 05.11.2031 (g) | £ | 21.567 | 35.504 | 0,18 |
| **HSBC Capital Funding LP** | | | | |
| 10,176 % fällig am 30.06.2030 (g) | $ | 600 | $ 933 | 0,01 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025 | € | 200 | 236 | 0,00 |
| 3,950 % fällig am 30.06.2022 | £ | 4.600 | 5.996 | 0,03 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 136.119 | 0,68 |
| **KUWAIT** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kuwait International Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.03.2022 | $ | 44.200 | 44.862 | 0,22 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2027 | | 12.900 | 13.753 | 0,07 |
| Summe Kuwait | | | 58.615 | 0,29 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adecoagro S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 21.09.2027 | | 5.800 | 5.568 | 0,03 |
| **Allergan Funding SCS** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.03.2022 | | 21.970 | 22.440 | 0,11 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.05.2026 | | 8.700 | 8.766 | 0,05 |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 | | 2.180 | 2.221 | 0,01 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 07.01.2025 | € | 500 | 574 | 0,00 |
| 1,500 % fällig am 15.07.2024 | | 34.000 | 40.409 | 0,20 |
| 1,875 % fällig am 19.01.2026 | | 300 | 359 | 0,00 |
| 2,000 % fällig am 02.11.2026 | | 11.500 | 13.780 | 0,07 |
| 2,125 % fällig am 13.03.2023 | | 1.000 | 1.213 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 16.10.2029 | £ | 14.600 | 18.106 | 0,09 |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 59.000 | 63.879 | 0,32 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.02.2023 | € | 2.000 | 2.363 | 0,01 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | |
| 1,400 % fällig am 06.07.2022 | | 7.500 | 8.748 | 0,04 |
| 2,000 % fällig am 15.02.2024 | | 13.200 | 15.780 | 0,08 |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | | 22.100 | 26.622 | 0,13 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(c) | $ | 8.624 | 4.140 | 0,02 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (9,000 % bar und 0,500 % PIK)** | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(c) | | 352 | 169 | 0,00 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 | € | 4.900 | 5.593 | 0,03 |
| **Covidien International Finance S.A.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.06.2022 | $ | 6.300 | 6.477 | 0,03 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | € | 12.500 | 14.455 | 0,07 |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | | 28.800 | 33.641 | 0,17 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 11.300 | 11.711 | 0,06 |
| **Dream Global Funding SARL** | | | | |
| 1,375 % fällig am 21.12.2021 | € | 1.900 | 2.204 | 0,01 |
| 1,750 % fällig am 28.06.2026 | | 9.300 | 10.711 | 0,05 |
| **Eurofins Scientific SE** | | | | |
| 2,125 % fällig am 25.07.2024 (k) | | 12.100 | 13.775 | 0,07 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.09.2022 | $ | 14.200 | 14.505 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | | 7.500 | 8.160 | 0,04 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 22.11.2024 | € | 7.500 | 8.888 | 0,05 |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | | 43.500 | 53.145 | 0,27 |
| 3,125 % fällig am 17.11.2023 | | 1.900 | 2.343 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 06.04.2024 | £ | 8.000 | 10.833 | 0,06 |
| 4,950 % fällig am 19.07.2022 | $ | 13.100 | 13.762 | 0,07 |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 41.200 | 43.981 | 0,22 |
| 6,510 % fällig am 07.03.2022 | | 20.239 | 21.900 | 0,11 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.04.2021 | € | 4.300 | 4.939 | 0,03 |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | | 40.500 | 47.742 | 0,24 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | | 5.200 | 6.321 | 0,03 |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | | 1.700 | 2.148 | 0,01 |
| **Medtronic Global Holdings S.C.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 02.07.2025 (b) | | 1.500 | 1.704 | 0,01 |
| 0,375 % fällig am 07.03.2023 | | 2.100 | 2.421 | 0,01 |
| 1,125 % fällig am 07.03.2027 | | 7.100 | 8.441 | 0,04 |
| 1,500 % fällig am 02.07.2039 (b) | | 1.500 | 1.692 | 0,01 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | |
| 1,876 % fällig am 17.04.2025 | € | 360 | $ 444 | 0,00 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,717 % fällig am 16.06.2021 | $ | 18.350 | 19.126 | 0,10 |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 25.850 | 27.490 | 0,14 |
| **SELP Finance SARL** | | | | |
| 1,250 % fällig am 25.10.2023 | € | 22.200 | 26.090 | 0,13 |
| | | | 659.779 | 3,31 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Delos Finance SARL** | | | | |
| 4,080 % fällig am 06.10.2023 | $ | 21.718 | 21.727 | 0,11 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics S.A.** | | | | |
| 5,680 % fällig am 30.06.2025 | | 3.740 | 3.603 | 0,01 |
| | | | 25.330 | 0,12 |
| Summe Luxemburg | | | 685.109 | 3,43 |
| **MAURITIUS** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Greenko Dutch BV** | | | | |
| 5,250 % fällig am 24.07.2024 | | 1.900 | 1.872 | 0,01 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **MEXIKO** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **Desarrolladora Homex S.A.B. de C.V. (d)** | | 427.064 | 2 | 0,00 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **America Movil S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 30.03.2020 | $ | 2.735 | 2.787 | 0,01 |
| **Banco Inbursa S.A. Institucion de Banca Multiple** | | | | |
| 4,375 % fällig am 11.04.2027 | | 15.850 | 15.731 | 0,08 |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 27.09.2024 (g)(i) | | 12.600 | 12.600 | 0,06 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 18.01.2033 (i) | | 32.000 | 30.912 | 0,16 |
| 6,500 % fällig am 10.03.2021 | | 13.600 | 14.328 | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | | 11.650 | 12.708 | 0,06 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 2,500 % fällig am 21.08.2021 | € | 15.400 | 17.604 | 0,09 |
| 4,500 % fällig am 23.01.2026 | $ | 6.100 | 5.616 | 0,03 |
| 6,350 % fällig am 12.02.2048 | | 4.000 | 3.449 | 0,02 |
| **Trust F** | | | | |
| 4,869 % fällig am 15.01.2030 | | 10.300 | 10.388 | 0,05 |
| 6,950 % fällig am 30.01.2044 | | 21.200 | 23.787 | 0,12 |
| | | | 149.910 | 0,75 |
| Summe Mexiko | | | 149.912 | 0,75 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ASR Nederland NV** | | | | |
| 3,375 % fällig am 02.05.2049 | € | 4.600 | 5.462 | 0,03 |
| **BNG Bank NV** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.03.2026 | $ | 9.900 | 10.104 | 0,05 |
| **British Transco International Finance BV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.11.2021 (e) | | 1.810 | 1.703 | 0,01 |
| **Cetin Finance BV** | | | | |
| 1,423 % fällig am 06.12.2021 | € | 8.300 | 9.740 | 0,05 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 4,625 % fällig am 29.12.2025 (g)(i) | | 19.600 | 23.986 | 0,12 |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (g)(i) | | 20.146 | 23.915 | 0,12 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (g)(i) | | 49.800 | 62.904 | 0,32 |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 (i) | | 35.500 | 42.436 | 0,21 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 4,375 % fällig am 21.06.2028 | $ | 6.200 | 6.762 | 0,03 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 2,750 % fällig am 06.04.2023 | | 9.455 | 9.436 | 0,05 |
| 2,875 % fällig am 25.05.2022 | | 18.600 | 18.755 | 0,09 |
| 3,625 % fällig am 25.05.2027 | | 8.900 | 8.949 | 0,04 |
| 4,625 % fällig am 14.09.2025 | | 33.200 | 35.668 | 0,18 |
| 4,875 % fällig am 14.06.2029 | | 1.800 | 1.977 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **IMCD NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.03.2025 | € | 5.000 | $ 5.855 | 0,03 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 3,000 % fällig am 18.02.2026 | £ | 4.900 | 6.528 | 0,03 |
| 3,550 % fällig am 09.04.2024 | $ | 5.400 | 5.590 | 0,03 |
| 4,050 % fällig am 09.04.2029 | | 5.100 | 5.445 | 0,03 |
| 4,100 % fällig am 02.10.2023 | | 19.800 | 20.931 | 0,11 |
| 4,625 % fällig am 06.01.2026 (k) | | 4.800 | 5.240 | 0,03 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 1,750 % fällig am 25.06.2026 | € | 5.100 | 6.116 | 0,03 |
| **JT International Financial Services BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.09.2023 | $ | 9.300 | 9.668 | 0,05 |
| **LafargeHolcim Sterling Finance Netherlands BV** | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.05.2032 | £ | 100 | 129 | 0,00 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 02.05.2023 | € | 17.500 | 20.291 | 0,10 |
| 7,375 % fällig am 29.05.2024 (g)(i) | | 1.200 | 1.442 | 0,01 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.10.2021 | $ | 18.113 | 17.952 | 0,09 |
| **Mylan NV** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.06.2021 | | 17.955 | 17.965 | 0,09 |
| 3,750 % fällig am 15.12.2020 | | 16.374 | 16.532 | 0,08 |
| 3,950 % fällig am 15.06.2026 | | 28.299 | 27.389 | 0,14 |
| **Nationale-Nederlanden Bank NV** | | | | |
| 0,375 % fällig am 31.05.2023 | € | 3.900 | 4.480 | 0,02 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (g) | | 4.500 | 5.672 | 0,03 |
| **NXP BV** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.09.2022 | $ | 36.000 | 37.107 | 0,19 |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | | 5.200 | 5.333 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 01.06.2023 | | 3.000 | 3.170 | 0,02 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,933 % fällig am 23.04.2021 | | 3.936 | 4.009 | 0,02 |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | | 2.800 | 2.913 | 0,01 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 13.400 | 13.996 | 0,07 |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 19.200 | 19.991 | 0,10 |
| **Telefonica Europe BV** | | | | |
| 4,375 % fällig am 14.12.2024 (g) | € | 5.000 | 6.194 | 0,03 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 0,375 % fällig am 25.07.2020 | | 4.200 | 4.706 | 0,02 |
| 1,125 % fällig am 15.10.2024 | | 2.500 | 2.365 | 0,01 |
| 1,250 % fällig am 31.03.2023 | | 19.650 | 20.000 | 0,10 |
| 1,700 % fällig am 19.07.2019 | $ | 4.095 | 4.084 | 0,02 |
| 2,200 % fällig am 21.07.2021 | | 29.473 | 28.073 | 0,14 |
| 2,800 % fällig am 21.07.2023 | | 30.975 | 26.871 | 0,13 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2022 | € | 6.000 | 6.759 | 0,03 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 07.09.2021 | £ | 6.200 | 7.929 | 0,04 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.03.2021 | € | 6.400 | 7.340 | 0,04 |
| 1,239 % fällig am 16.11.2024 | | 9.400 | 10.930 | 0,05 |
| **Vonovia Finance BV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 02.10.2023 | $ | 500 | 530 | 0,00 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.04.2027 | € | 8.000 | 9.578 | 0,05 |
| 2,250 % fällig am 09.04.2026 | | 16.300 | 19.821 | 0,10 |
| | | | 680.721 | 3,41 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Diamond (BC) BV** | | | | |
| 5,583 % fällig am 06.09.2024 | $ | 204 | 180 | 0,00 |
| **Sigma Bidco BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 02.07.2025 | € | 3.000 | 3.351 | 0,02 |
| | | | 3.531 | 0,02 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **EMF-NL Prime BV** | | | | |
| 0,490 % fällig am 17.04.2041 | | 1.163 | 1.272 | 0,01 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 1,190 % fällig am 17.10.2040 | | 822 | 936 | 0,00 |
| | | | 2.208 | 0,01 |
| Summe Niederlande | | | 686.460 | 3,44 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ANZ New Zealand International Ltd.** | | | | |
| 0,625 % fällig am 01.06.2021 | € | 8.500 | $ 9.822 | 0,05 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Norwegian Air Shuttle ASA Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,875 % fällig am 10.11.2029 | $ | 8.638 | 8.358 | 0,04 |
| **Telenor ASA** | | | | |
| 0,750 % fällig am 31.05.2026 | € | 8.600 | 10.097 | 0,05 |
| **Yara International ASA** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.06.2028 | $ | 26.500 | 28.592 | 0,15 |
| Summe Norwegen | | | 47.047 | 0,24 |
| **PANAMA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco General S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 07.08.2027 | | 6.300 | 6.395 | 0,03 |
| **Intercorp Financial Services, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 19.10.2027 | | 9.200 | 9.263 | 0,05 |
| Summe Panama | | | 15.658 | 0,08 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Corp. Financiera de Desarrollo S.A.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.07.2019 | | 6.000 | 6.003 | 0,03 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,700 % fällig am 12.08.2024 | PEN | 120.000 | 39.693 | 0,20 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 22.400 | 7.496 | 0,04 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 141.000 | 48.169 | 0,24 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 187.000 | 70.760 | 0,35 |
| Summe Peru | | | 172.121 | 0,86 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2019 | $ | 2.300 | 2.321 | 0,01 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **State Of Qatar** | | | | |
| 2,983 % fällig am 21.12.2020 | | 46.000 | 45.885 | 0,23 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.03.2024 | | 22.500 | 23.279 | 0,12 |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | | 14.300 | 15.017 | 0,08 |
| 4,000 % fällig am 14.03.2029 | | 6.000 | 6.476 | 0,03 |
| | | | 44.772 | 0,23 |
| Summe Katar | | | 92.978 | 0,47 |
| **RUSSLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ALROSA Finance S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 09.04.2024 | | 5.200 | 5.396 | 0,03 |
| **MMK International Capital DAC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 13.06.2024 | | 5.000 | 5.076 | 0,02 |
| Summe Russland | | | 10.472 | 0,05 |
| **SAUDI-ARABIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 26.10.2021 | | 35.200 | 35.184 | 0,18 |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 29.200 | 29.583 | 0,15 |
| 3,250 % fällig am 26.10.2026 | | 18.400 | 18.799 | 0,09 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 31.600 | 33.683 | 0,17 |
| Summe Saudi-Arabien | | | 117.249 | 0,59 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.09.2021 | | 2.000 | 1.978 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | $ | 19.700 | $ 19.676 | 0,10 |
| 3,000 % fällig am 30.03.2020 | | 300 | 301 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 1.600 | 1.627 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 10.10.2024 | | 10.200 | 10.371 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 18.09.2027 | | 20.100 | 20.029 | 0,10 |
| 4,000 % fällig am 25.01.2024 | | 3.400 | 3.528 | 0,02 |
| **Flex Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.06.2029 | | 9.800 | 10.005 | 0,05 |
| **SP PowerAssets Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 26.09.2027 | | 2.600 | 2.645 | 0,01 |
| Summe Singapur | | | 70.160 | 0,35 |
| **SLOWAKEI** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Slovakia Government International Bond** | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.03.2037 | € | 500 | 678 | 0,00 |
| **SLOWENIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Slovenia Government International Bond** | | | | |
| 3,125 % fällig am 07.08.2045 | | 400 | 661 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 18.02.2024 | $ | 5.474 | 6.162 | 0,03 |
| Summe Slowenien | | | 6.823 | 0,03 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **SK Telecom Co. Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.04.2023 | | 3.200 | 3.326 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 2,625 % fällig am 30.12.2020 | | 20.000 | 20.106 | 0,10 |
| **Korea Development Bank** | | | | |
| 4,625 % fällig am 16.11.2021 | | 300 | 316 | 0,00 |
| | | | 20.422 | 0,10 |
| Summe Südkorea | | | 23.748 | 0,12 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (g)(i) | € | 5.000 | 5.902 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (g)(i) | | 15.600 | 18.697 | 0,09 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (g)(i) | | 18.600 | 21.806 | 0,11 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 2,706 % fällig am 27.06.2024 | $ | 14.800 | 14.828 | 0,08 |
| 3,306 % fällig am 27.06.2029 | | 13.500 | 13.612 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 19.03.2025 (g)(i) | € | 17.200 | 18.562 | 0,09 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (g)(i) | | 22.000 | 26.400 | 0,13 |
| **Bankinter S.A.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 08.07.2026 (b) | | 10.600 | 12.058 | 0,06 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | | 20.600 | 24.503 | 0,12 |
| 5,250 % fällig am 23.03.2026 (g)(i) | | 8.800 | 9.438 | 0,05 |
| **IE2 Holdco S.A.U.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.06.2026 | | 5.300 | 6.772 | 0,04 |
| **Inmobiliaria Colonial Socimi S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 28.11.2025 | | 13.800 | 16.498 | 0,08 |
| **Merlin Properties Socimi S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 26.05.2025 | | 35.300 | 42.142 | 0,21 |
| 2,225 % fällig am 25.04.2023 | | 15.165 | 18.419 | 0,09 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | | |
| 5,877 % fällig am 15.07.2019 | $ | 28.186 | 28.219 | 0,14 |
| | | | 277.856 | 1,39 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | |
| 2,146 % fällig am 30.04.2027 | € | 500 | 649 | 0,01 |
| Summe Spanien | | | 278.505 | 1,40 |
| **SRI LANKA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 6,200 % fällig am 11.05.2027 | $ | 200 | 190 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **SCHWEDEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Fastighets AB Balder** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 14.03.2025 | € | 9.600 | $ | 11.327 | 0,06 |
| **Sagax AB** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | | 10.000 | | 11.861 | 0,06 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget Norden AB** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2025 | | 4.700 | | 5.450 | 0,03 |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | | |
| 2,400 % fällig am 01.10.2020 | $ | 16.200 | | 16.223 | 0,08 |
| Summe Schweden | | | | 44.861 | 0,23 |
| **SCHWEIZ** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.10.2021 | | 1.400 | | 1.423 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 09.09.2024 | | 13.350 | | 14.072 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (i) | | 96.560 | | 106.518 | 0,53 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 24.06.2027 | € | 7.200 | | 8.318 | 0,04 |
| 3,574 % fällig am 09.01.2023 | $ | 2.975 | | 3.039 | 0,01 |
| 4,207 % fällig am 12.06.2024 | | 44.475 | | 46.694 | 0,23 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (g)(i) | | 27.400 | | 29.285 | 0,15 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (i) | | 50.100 | | 53.240 | 0,27 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (i) | | 75.281 | | 84.473 | 0,42 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | | |
| 3,468 % fällig am 15.08.2023 | | 54.800 | | 54.936 | 0,28 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 104.350 | | 111.458 | 0,56 |
| Summe Schweiz | | | | 513.456 | 2,57 |
| **THAILAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Bangkok Bank PCL** | | | | | |
| 4,800 % fällig am 18.10.2020 | | 2.200 | | 2.265 | 0,01 |
| **TÜRKEI** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Turkish Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2028 | | 6.341 | | 5.840 | 0,03 |
| **UKRAINE** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 25.09.2032 | | 3.900 | | 3.845 | 0,02 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **DP World PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.09.2026 | € | 14.000 | | 16.722 | 0,08 |
| 4,250 % fällig am 25.09.2030 | £ | 4.600 | | 6.351 | 0,03 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.03.2022 | $ | 11.600 | | 11.724 | 0,06 |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 24.700 | | 24.854 | 0,13 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | | 59.651 | 0,30 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Ardonagh Midco PLC** | | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.07.2023 (k) | £ | 6.400 | | 7.498 | 0,04 |
| 8,375 % fällig am 15.07.2023 | | 3.100 | | 3.632 | 0,02 |
| **Assura Financing PLC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.07.2028 | | 4.800 | | 6.516 | 0,03 |
| **Bank of Scotland PLC** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 16.08.2019 | | 450 | | 576 | 0,00 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (i) | $ | 48.885 | | 53.412 | 0,27 |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | £ | 13.000 | | 17.042 | 0,09 |
| 3,200 % fällig am 10.08.2021 | $ | 9.600 | | 9.672 | 0,05 |
| 3,250 % fällig am 12.01.2021 | | 2.700 | | 2.722 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | £ | 8.903 | | 11.580 | 0,06 |
| 3,250 % fällig am 17.01.2033 | | 500 | | 621 | 0,00 |
| 3,905 % fällig am 16.05.2024 | $ | 2.700 | $ | 2.662 | 0,01 |
| 4,209 % fällig am 10.01.2023 | | 8.800 | | 8.823 | 0,04 |
| 4,338 % fällig am 16.05.2024 | | 1.100 | | 1.137 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 12.01.2026 | | 16.000 | | 16.593 | 0,08 |
| 5,875 % fällig am 15.09.2024 (g)(i) | £ | 8.868 | | 10.962 | 0,06 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (g)(i) | € | 6.600 | | 7.610 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (g)(i) | £ | 11.800 | | 15.712 | 0,08 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (g)(i) | | 28.250 | | 37.533 | 0,19 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (g)(i) | € | 1.800 | | 2.222 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (g)(i) | $ | 300 | | 315 | 0,00 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.09.2019 | | 2.000 | | 1.996 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 09.09.2052 | £ | 2.750 | | 2.498 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | $ | 7.834 | | 7.854 | 0,04 |
| 3,950 % fällig am 15.06.2025 | | 9.945 | | 10.303 | 0,05 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.10.2041 | | 1.430 | | 1.692 | 0,01 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 21.11.2024 | € | 12.400 | | 14.572 | 0,07 |
| 3,125 % fällig am 21.11.2031 | £ | 8.000 | | 10.713 | 0,05 |
| **Broadgate Financing PLC** | | | | | |
| 4,851 % fällig am 05.04.2033 | | 60 | | 98 | 0,00 |
| **Bunzl Finance PLC** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.06.2025 | | 4.100 | | 5.261 | 0,03 |
| **Cadent Finance PLC** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 22.09.2028 | | 4.900 | | 6.215 | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 22.09.2046 | | 3.400 | | 4.239 | 0,02 |
| **Connect Plus M25 Issuer PLC** | | | | | |
| 2,607 % fällig am 31.03.2039 | | 8.167 | | 11.217 | 0,06 |
| **Drax Finco PLC** | | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.11.2025 | $ | 3.200 | | 3.287 | 0,02 |
| **DS Smith PLC** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 26.07.2029 | £ | 100 | | 129 | 0,00 |
| **FCE Bank PLC** | | | | | |
| 0,869 % fällig am 13.09.2021 | € | 9.800 | | 11.199 | 0,06 |
| 1,875 % fällig am 24.06.2021 | | 1.600 | | 1.865 | 0,01 |
| **G4S International Finance PLC** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 24.05.2025 | | 23.300 | | 27.172 | 0,14 |
| **Grainger PLC** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2028 | £ | 7.500 | | 9.869 | 0,05 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | | |
| 1,736 % fällig am 15.06.2031 | | 551 | | 662 | 0,00 |
| 2,866 % fällig am 15.03.2036 | | 1.000 | | 1.021 | 0,01 |
| 4,064 % fällig am 15.03.2035 | | 6.001 | | 8.241 | 0,04 |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | | 272 | | 402 | 0,00 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 16.08.2028 | | 10.700 | | 13.938 | 0,07 |
| 3,000 % fällig am 22.07.2028 | | 9.600 | | 12.755 | 0,06 |
| 3,520 % fällig am 18.05.2024 | $ | 3.003 | | 3.013 | 0,02 |
| 3,681 % fällig am 11.03.2025 | | 37.550 | | 37.678 | 0,19 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 15.500 | | 16.204 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 04.07.2029 (g)(i) | € | 31.200 | | 37.393 | 0,19 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (g)(i) | | 21.690 | | 26.682 | 0,13 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (g)(i) | | 4.219 | | 5.556 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (g) | | 24.730 | | 32.566 | 0,16 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.08.2023 | | 12.800 | | 14.882 | 0,07 |
| 2,125 % fällig am 12.02.2027 | | 7.500 | | 8.934 | 0,04 |
| 2,950 % fällig am 21.07.2020 | $ | 4.984 | | 4.999 | 0,03 |
| **Informa PLC** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 05.07.2023 | € | 14.700 | | 17.403 | 0,09 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 24.08.2026 | £ | 6.640 | | 8.348 | 0,04 |
| **Liberty Living Finance PLC** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 28.11.2024 | | 5.083 | | 6.566 | 0,03 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 02.04.2032 | $ | 27.200 | | 21.721 | 0,11 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | £ | 9.500 | | 12.149 | 0,06 |
| 3,000 % fällig am 11.01.2022 | $ | 3.500 | | 3.538 | 0,02 |
| 3,186 % fällig am 21.06.2021 | | 25.200 | | 25.217 | 0,13 |
| 3,574 % fällig am 07.11.2028 | | 6.600 | | 6.612 | 0,03 |
| 3,750 % fällig am 11.01.2027 | | 1.800 | | 1.834 | 0,01 |
| 4,050 % fällig am 16.08.2023 | | 18.500 | | 19.324 | 0,10 |
| 4,450 % fällig am 08.05.2025 | | 5.300 | | 5.647 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (g)(i) | £ | 11.075 | | 16.024 | 0,08 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.12.2023 | | 13.600 | | 17.718 | 0,09 |
| 6,125 % fällig am 06.12.2021 | | 3.400 | | 4.758 | 0,02 |
| **Miller Homes Group Holdings PLC** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2024 | £ | 2.500 | $ | 3.221 | 0,02 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | | |
| 1,236 % fällig am 15.12.2030 | | 930 | | 1.111 | 0,01 |
| **Mondi Finance PLC** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.04.2024 | € | 2.100 | | 2.520 | 0,01 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | | |
| 0,375 % fällig am 03.01.2026 (b) | | 10.200 | | 11.650 | 0,06 |
| 2,375 % fällig am 03.07.2039 (b) | £ | 9.800 | | 12.210 | 0,06 |
| **National Express Group PLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.11.2023 | | 7.100 | | 9.164 | 0,05 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 08.03.2026 | € | 9.600 | | 11.183 | 0,06 |
| 3,622 % fällig am 26.04.2023 | $ | 6.300 | | 6.419 | 0,03 |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 6.500 | | 6.639 | 0,03 |
| 3,900 % fällig am 21.07.2025 | | 2.400 | | 2.528 | 0,01 |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | | 10.200 | | 10.678 | 0,05 |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | | 39.100 | | 40.840 | 0,20 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | | |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | € | 11.300 | | 12.940 | 0,06 |
| **Peabody Capital PLC** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 14.09.2048 | £ | 8.100 | | 10.958 | 0,05 |
| **Petra Diamonds U.S. Treasury PLC** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.05.2022 | $ | 14.350 | | 14.279 | 0,07 |
| **Places For People Treasury PLC** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 17.08.2026 | £ | 8.800 | | 11.329 | 0,06 |
| **RAC Bond Co. PLC** | | | | | |
| 4,565 % fällig am 06.05.2046 | | 17.900 | | 22.696 | 0,11 |
| 4,870 % fällig am 06.05.2046 | | 3.864 | | 4.839 | 0,02 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.06.2022 | $ | 3.000 | | 2.998 | 0,02 |
| 2,903 % fällig am 24.06.2022 | | 3.000 | | 2.991 | 0,02 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 08.03.2023 | € | 2.925 | | 3.442 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 22.120 | | 26.184 | 0,13 |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | | 30.758 | | 37.228 | 0,19 |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | $ | 22.772 | | 22.739 | 0,11 |
| 3,988 % fällig am 15.05.2023 | | 5.000 | | 4.988 | 0,03 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 21.700 | | 22.455 | 0,11 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 500 | | 521 | 0,00 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | | 6.000 | | 6.423 | 0,03 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | | 8.200 | | 8.763 | 0,04 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 19.800 | | 21.499 | 0,11 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (g)(i) | | 5.600 | | 6.049 | 0,03 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 0,505 % fällig am 27.03.2024 | € | 1.300 | | 1.456 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 05.08.2021 | $ | 25.580 | | 25.628 | 0,13 |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | | 27.533 | | 27.818 | 0,14 |
| 3,625 % fällig am 14.01.2026 | £ | 700 | | 954 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | $ | 24.817 | | 25.804 | 0,13 |
| 4,796 % fällig am 15.11.2024 | | 44.645 | | 47.462 | 0,24 |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (g)(i) | £ | 25.550 | | 34.032 | 0,17 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (g)(i) | | 20.533 | | 27.815 | 0,14 |
| **Santander UK PLC** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 18.06.2024 | $ | 22.800 | | 22.951 | 0,12 |
| 3,178 % fällig am 15.11.2021 | | 600 | | 602 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 07.11.2023 | | 300 | | 317 | 0,00 |
| **Sky Ltd.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.09.2024 | | 8.300 | | 8.826 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 21.05.2027 | £ | 1.300 | | 2.163 | 0,01 |
| **Society of Lloyd's** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | | 1.300 | | 1.831 | 0,01 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | | |
| 3,474 % fällig am 28.12.2031 | | 80 | | 101 | 0,00 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | | |
| 0,900 % fällig am 02.07.2027 (b) | € | 4.700 | | 5.368 | 0,03 |
| 4,305 % fällig am 21.05.2030 | $ | 5.800 | | 6.017 | 0,03 |
| **Telereal Secured Finance PLC** | | | | | |
| 4,010 % fällig am 10.12.2033 | £ | 301 | | 417 | 0,00 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.10.2023 | € | 11.250 | | 13.270 | 0,07 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | | |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | £ | 7.784 | | 12.956 | 0,07 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 2.929 | | 4.931 | 0,02 |
| **TP ICAP PLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | | 14.630 | | 19.485 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 18.000 | | 23.467 | 0,12 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | £ | 6.417 | $ | 9.180 | 0,05 |
| **Vedanta Resources Ltd.** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 07.06.2021 | $ | 2.900 | | 3.017 | 0,02 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | £ | 17.810 | | 23.430 | 0,12 |
| **Virgin Money Holdings UK PLC** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 31.07.2019 (g)(i) | | 300 | | 384 | 0,00 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 30.05.2025 | $ | 8.000 | | 8.513 | 0,04 |
| 4,375 % fällig am 30.05.2028 | | 6.400 | | 6.924 | 0,03 |
| 4,875 % fällig am 19.06.2049 | | 2.600 | | 2.743 | 0,01 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 18.04.2025 | £ | 1.300 | | 1.683 | 0,01 |
| | | | | 1.469.833 | 7,37 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Canary Wharf Finance PLC** | | | | | |
| 5,952 % fällig am 22.10.2037 | | 55 | | 102 | 0,00 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 2,532 % fällig am 18.06.2039 | $ | 2.174 | | 2.116 | 0,01 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | | |
| 0,953 % fällig am 01.12.2050 | £ | 192 | | 231 | 0,00 |
| **Oncilla Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 2,193 % fällig am 12.12.2043 | | 494 | | 634 | 0,01 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,743 % fällig am 12.03.2048 | | 92 | | 117 | 0,00 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | | |
| 1,136 % fällig am 10.06.2059 | | 51 | | 61 | 0,00 |
| 1,336 % fällig am 10.06.2059 | | 40 | | 48 | 0,00 |
| 1,536 % fällig am 10.06.2059 | | 43 | | 51 | 0,00 |
| | | | | 3.360 | 0,02 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2046 (f) | | 112 | | 240 | 0,00 |
| 0,625 % fällig am 22.03.2040 (f) | | 196 | | 420 | 0,00 |
| | | | | 660 | 0,00 |
| Summe Großbritannien | | | | 1.473.853 | 7,39 |
| **USA** | | | | | |
| **FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **AASET Trust** | | | | | |
| 3,967 % fällig am 16.05.2042 | $ | 6.896 | | 6.981 | 0,04 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 3,304 % fällig am 25.12.2034 | | 1.583 | | 1.571 | 0,01 |
| 3,349 % fällig am 25.05.2035 | | 2.000 | | 1.967 | 0,01 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | | 6.212 | | 4.963 | 0,03 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 2,794 % fällig am 25.03.2036 | | 1.986 | | 1.988 | 0,01 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.01.2036 | | 8.897 | | 8.874 | 0,04 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 2,814 % fällig am 25.12.2035 | | 34 | | 34 | 0,00 |
| **Business Jet Securities LLC** | | | | | |
| 4,335 % fällig am 15.02.2033 | | 5.319 | | 5.380 | 0,03 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.** | | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.07.2036 | | 38 | | 38 | 0,00 |
| 2,694 % fällig am 25.06.2036 | | 1.017 | | 1.018 | 0,01 |
| 2,744 % fällig am 25.04.2036 | | 493 | | 494 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.02.2036 | | 31 | | 31 | 0,00 |
| 3,204 % fällig am 25.03.2033 | | 768 | | 765 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 3,144 % fällig am 25.08.2032 | | 133 | | 132 | 0,00 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.10.2035 | | 966 | | 965 | 0,01 |
| 3,289 % fällig am 25.03.2035 | | 946 | | 954 | 0,01 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | | |
| 2,590 % fällig am 25.08.2036 | | 8.797 | | 3.866 | 0,02 |
| 3,094 % fällig am 25.01.2035 | | 488 | | 489 | 0,00 |
| **GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.12.2035 | | 631 | | 631 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | $ | 3.893 | $ | 3.791 | 0,02 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | | |
| 2,894 % fällig am 25.12.2035 | | 341 | | 343 | 0,00 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.04.2037 | | 6.716 | | 5.109 | 0,03 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | | |
| 3,334 % fällig am 25.09.2035 | | 129 | | 131 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | | 2.736 | | 2.737 | 0,01 |
| **L2L Education Loan Trust** | | | | | |
| 2,780 % fällig am 15.06.2031 | | 3.696 | | 3.529 | 0,02 |
| **Labrador Aviation Finance Ltd.** | | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.01.2042 | | 18.465 | | 19.042 | 0,10 |
| **Lehman XS Trust** | | | | | |
| 3,204 % fällig am 25.10.2035 | | 842 | | 839 | 0,00 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.12.2036 | | 6.515 | | 4.976 | 0,03 |
| 3,304 % fällig am 25.06.2035 | | 1.241 | | 1.248 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.04.2035 | | 333 | | 336 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.06.2035 | | 7.100 | | 7.123 | 0,04 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.04.2035 | | 1.900 | | 1.867 | 0,01 |
| **National Collegiate Student Loan Trust** | | | | | |
| 2,674 % fällig am 26.03.2029 | | 64 | | 64 | 0,00 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 2,914 % fällig am 25.09.2035 | | 2.041 | | 2.047 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.11.2034 | | 354 | | 356 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 | | 6.632 | | 4.397 | 0,02 |
| **Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates** | | | | | |
| 2,844 % fällig am 25.11.2035 | | 190 | | 191 | 0,00 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | | |
| 2,864 % fällig am 25.12.2035 | | 547 | | 469 | 0,00 |
| 3,049 % fällig am 25.11.2035 | | 740 | | 743 | 0,00 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.04.2036 | | 529 | | 531 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.05.2037 | | 2.729 | | 2.729 | 0,01 |
| 2,844 % fällig am 25.11.2035 | | 4.800 | | 4.821 | 0,02 |
| 3,064 % fällig am 25.11.2035 | | 673 | | 676 | 0,00 |
| 3,274 % fällig am 25.05.2035 | | 291 | | 292 | 0,00 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | | |
| 2,694 % fällig am 25.12.2035 | | 1.132 | | 1.118 | 0,01 |
| 3,079 % fällig am 25.01.2035 | | 294 | | 292 | 0,00 |
| **SLM Private Credit Student Loan Trust** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 16.12.2041 | | 3.714 | | 3.623 | 0,02 |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | | | |
| 5,644 % fällig am 16.05.2044 | | 32 | | 32 | 0,00 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.06.2036 | | 1.058 | | 1.054 | 0,01 |
| 2,634 % fällig am 25.06.2036 | | 6.600 | | 6.383 | 0,03 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | | |
| 2,714 % fällig am 25.01.2036 | | 7.252 | | 6.962 | 0,04 |
| 3,094 % fällig am 25.06.2035 | | 414 | | 416 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.02.2035 | | 826 | | 832 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | | |
| 2,894 % fällig am 25.02.2035 | | 450 | | 451 | 0,00 |
| | | | | 130.691 | 0,66 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | | |
| 0,375 % fällig am 18.11.2019 | € | 14.800 | | 16.884 | 0,08 |
| 1,375 % fällig am 17.05.2024 | | 9.200 | | 10.963 | 0,06 |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.09.2021 | $ | 6.500 | | 6.490 | 0,03 |
| 3,400 % fällig am 15.09.2026 | | 3.100 | | 3.147 | 0,02 |
| 3,400 % fällig am 15.06.2027 | | 4.600 | | 4.626 | 0,02 |
| **Aetna, Inc.** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.06.2023 | | 1.800 | | 1.812 | 0,01 |
| **Air Lease Corp.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.12.2027 | | 2.800 | | 2.818 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.02.2024 | | 3.500 | | 3.695 | 0,02 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | | |
| 3,450 % fällig am 30.04.2025 | | 4.800 | | 4.944 | 0,02 |
| 4,300 % fällig am 15.01.2026 | | 20.750 | | 22.241 | 0,11 |
| 4,600 % fällig am 01.04.2022 | | 5.000 | | 5.273 | 0,03 |
| **Allegion U.S. Holding Co., Inc.** | | | | | |
| 3,200 % fällig am 01.10.2024 | $ | 2.000 | $ | 2.025 | 0,01 |
| 3,550 % fällig am 01.10.2027 | | 16.700 | | 16.479 | 0,08 |
| **Allergan Sales LLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2021 | | 33.428 | | 34.968 | 0,18 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 21.05.2024 | | 1.400 | | 1.437 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 17.590 | | 23.290 | 0,12 |
| **Altria Group, Inc.** | | | | | |
| 3,490 % fällig am 14.02.2022 | | 8.600 | | 8.848 | 0,04 |
| **Amazon.com, Inc.** | | | | | |
| 2,400 % fällig am 22.02.2023 | | 10.600 | | 10.710 | 0,05 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.04.2030 | | 2.599 | | 2.601 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2030 | | 2.108 | | 2.096 | 0,01 |
| 3,350 % fällig am 15.04.2031 | | 9.364 | | 9.480 | 0,05 |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 5.374 | | 5.478 | 0,03 |
| 3,600 % fällig am 15.04.2031 | | 5.675 | | 5.695 | 0,03 |
| 3,650 % fällig am 15.02.2029 | | 2.200 | | 2.287 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2027 | | 1.985 | | 2.072 | 0,01 |
| 4,100 % fällig am 15.07.2029 | | 1.396 | | 1.473 | 0,01 |
| **American Builders & Contractors Supply Co., Inc.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 2.750 | | 2.877 | 0,01 |
| **American Campus Communities Operating Partnership LP** | | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.07.2026 | | 4.500 | | 4.550 | 0,02 |
| 3,350 % fällig am 01.10.2020 | | 2.475 | | 2.502 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 15.04.2023 | | 7.650 | | 7.915 | 0,04 |
| **American Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.08.2026 | | 1.300 | | 1.309 | 0,01 |
| **American Homes 4 Rent LP** | | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.02.2029 | | 9.800 | | 10.678 | 0,05 |
| **American International Group, Inc.** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 21.06.2027 | € | 8.100 | | 9.729 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 01.04.2048 | $ | 1.300 | | 1.339 | 0,01 |
| **American Tower Corp.** | | | | | |
| 1,950 % fällig am 22.05.2026 | € | 13.300 | | 16.192 | 0,08 |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | $ | 12.460 | | 12.490 | 0,06 |
| 2,950 % fällig am 15.01.2025 | | 12.500 | | 12.605 | 0,06 |
| 3,300 % fällig am 15.02.2021 | | 7.197 | | 7.289 | 0,04 |
| 3,375 % fällig am 15.05.2024 | | 5.000 | | 5.147 | 0,03 |
| 3,450 % fällig am 15.09.2021 | | 405 | | 414 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.06.2025 | | 800 | | 844 | 0,00 |
| **American Transmission Systems, Inc.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2022 | | 14.100 | | 15.036 | 0,08 |
| **Amgen, Inc.** | | | | | |
| 2,600 % fällig am 19.08.2026 | | 28.300 | | 27.887 | 0,14 |
| 4,663 % fällig am 15.06.2051 | | 16.256 | | 17.780 | 0,09 |
| **Anadarko Petroleum Corp.** | | | | | |
| 5,550 % fällig am 15.03.2026 | | 3.085 | | 3.470 | 0,02 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2025 | | 950 | | 1.006 | 0,01 |
| 6,375 % fällig am 01.05.2024 | | 850 | | 894 | 0,00 |
| **Anheuser-Busch Cos. LLC** | | | | | |
| 4,900 % fällig am 01.02.2046 | | 37.600 | | 41.929 | 0,21 |
| **Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.** | | | | | |
| 4,600 % fällig am 15.04.2048 | | 10.000 | | 10.721 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 23.01.2029 | | 8.900 | | 10.111 | 0,05 |
| 4,900 % fällig am 23.01.2031 | | 1.200 | | 1.386 | 0,01 |
| 5,450 % fällig am 23.01.2039 | | 15.300 | | 18.239 | 0,09 |
| 5,550 % fällig am 23.01.2049 | | 8.900 | | 10.923 | 0,06 |
| 5,800 % fällig am 23.01.2059 | | 9.300 | | 11.673 | 0,06 |
| **Antero Midstream Partners LP** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | | 10.000 | | 10.025 | 0,05 |
| **Anthem, Inc.** | | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.12.2024 | | 26.000 | | 26.915 | 0,14 |
| **Apple, Inc.** | | | | | |
| 2,450 % fällig am 04.08.2026 | | 14.900 | | 14.862 | 0,07 |
| 2,850 % fällig am 11.05.2024 | | 1.500 | | 1.546 | 0,01 |
| **Arrow Electronics, Inc.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 08.09.2024 | | 2.400 | | 2.379 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 12.01.2028 | | 1.500 | | 1.489 | 0,01 |
| **Assurant, Inc.** | | | | | |
| 3,583 % fällig am 26.03.2021 | | 12.300 | | 12.301 | 0,06 |
| 4,200 % fällig am 27.09.2023 | | 3.100 | | 3.227 | 0,02 |
| **AT&T, Inc.** | | | | | |
| 2,350 % fällig am 05.09.2029 | € | 12.900 | | 16.369 | 0,08 |
| 3,150 % fällig am 04.09.2036 | | 7.600 | | 9.823 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | $ | 60.200 | $ 60.518 | 0,30 |
| 3,400 % fällig am 15.05.2025 | | 10.615 | 10.921 | 0,05 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 25.100 | 25.327 | 0,13 |
| 3,616 % fällig am 12.06.2024 | | 27.200 | 27.561 | 0,14 |
| 3,800 % fällig am 15.02.2027 | | 5.200 | 5.420 | 0,03 |
| 3,875 % fällig am 15.01.2026 | | 7.000 | 7.330 | 0,04 |
| 4,100 % fällig am 15.02.2028 | | 5.153 | 5.457 | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 17.02.2026 | | 22.335 | 23.777 | 0,12 |
| 4,350 % fällig am 01.03.2029 | | 11.200 | 12.074 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 09.03.2048 | | 6.500 | 6.656 | 0,03 |
| 4,550 % fällig am 09.03.2049 | | 25.013 | 25.572 | 0,13 |
| 4,750 % fällig am 15.05.2046 | | 3.300 | 3.490 | 0,02 |
| 4,800 % fällig am 15.06.2044 | | 8.007 | 8.465 | 0,04 |
| 4,850 % fällig am 25.05.2047 (j) | CAD | 12.800 | 10.337 | 0,05 |
| 5,150 % fällig am 15.03.2042 | $ | 4.753 | 5.205 | 0,03 |
| 5,150 % fällig am 15.11.2046 | | 10.000 | 11.074 | 0,06 |
| 5,150 % fällig am 15.02.2050 | | 3.000 | 3.317 | 0,02 |
| 5,300 % fällig am 15.08.2058 | | 4.700 | 5.242 | 0,03 |
| 5,350 % fällig am 01.09.2040 | | 847 | 958 | 0,00 |
| 5,450 % fällig am 01.03.2047 | | 12.600 | 14.496 | 0,07 |
| 6,375 % fällig am 01.03.2041 | | 6.320 | 7.866 | 0,04 |
| **Athene Global Funding** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.04.2020 | | 2.400 | 2.405 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2022 | | 2.525 | 2.556 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 25.01.2022 | | 11.110 | 11.498 | 0,06 |
| **Autodesk, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.06.2020 | | 2.215 | 2.226 | 0,01 |
| **AutoNation, Inc.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.01.2021 | | 7.716 | 7.789 | 0,04 |
| **AvalonBay Communities, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.10.2020 | | 900 | 912 | 0,00 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.11.2027 | | 4.802 | 4.809 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 01.05.2023 | | 1.000 | 1.034 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 06.04.2021 | | 6.869 | 7.339 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 15.10.2020 | | 32.395 | 34.274 | 0,17 |
| **AXA Equitable Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 20.04.2028 | | 25.050 | 26.366 | 0,13 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,491 % fällig am 07.02.2022 | € | 10.000 | 11.467 | 0,06 |
| 2,151 % fällig am 09.11.2020 | $ | 6.294 | 6.276 | 0,03 |
| 3,093 % fällig am 01.10.2025 | | 17.200 | 17.637 | 0,09 |
| 3,269 % fällig am 05.03.2024 | | 2.100 | 2.103 | 0,01 |
| 3,550 % fällig am 05.03.2024 | | 4.300 | 4.460 | 0,02 |
| 3,552 % fällig am 23.07.2024 | | 53.000 | 53.362 | 0,27 |
| 3,581 % fällig am 24.04.2023 | | 11.400 | 11.495 | 0,06 |
| **Bank of America N.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.10.2036 | | 7.650 | 10.098 | 0,05 |
| **Bank of New York Mellon Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 27.11.2020 | | 9.700 | 9.742 | 0,05 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 0,189 % fällig am 16.08.2021 | € | 7.500 | 8.540 | 0,04 |
| 2,125 % fällig am 15.08.2025 | £ | 100 | 126 | 0,00 |
| 2,764 % fällig am 15.08.2022 | $ | 7.600 | 7.614 | 0,04 |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | | 11.950 | 11.981 | 0,06 |
| 3,222 % fällig am 15.08.2024 | | 100 | 101 | 0,00 |
| 3,557 % fällig am 15.08.2027 | | 3.200 | 3.186 | 0,02 |
| 4,540 % fällig am 15.08.2047 | | 5.000 | 4.646 | 0,02 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,979 % fällig am 25.06.2021 | | 10.000 | 9.936 | 0,05 |
| 3,375 % fällig am 15.07.2024 | | 6.100 | 6.138 | 0,03 |
| 3,420 % fällig am 15.12.2023 | | 17.700 | 17.393 | 0,09 |
| 3,500 % fällig am 25.06.2021 | | 6.300 | 6.393 | 0,03 |
| 3,875 % fällig am 15.12.2023 | | 17.100 | 17.769 | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 15.12.2025 | | 2.500 | 2.647 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 15.12.2028 | | 3.800 | 4.010 | 0,02 |
| **Becton Dickinson and Co.** | | | | |
| 2,675 % fällig am 15.12.2019 | | 1.518 | 1.519 | 0,01 |
| **Berkshire Hathaway Energy Co.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 01.02.2020 | | 1.100 | 1.100 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 15.11.2023 | | 3.000 | 3.168 | 0,02 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 27.05.2021 | | 37.450 | 38.727 | 0,19 |
| **Blackstone Holdings Finance Co. LLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 10.04.2029 | € | 13.800 | 16.294 | 0,08 |
| **Block Communications, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2025 | $ | 900 | 943 | 0,00 |
| **Blue Racer Midstream LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.07.2026 | | 2.300 | 2.329 | 0,01 |
| **Bluescope Finance Americas LLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.05.2023 | $ | 29.700 | $ 31.052 | 0,16 |
| **Boston Scientific Corp.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.05.2022 | | 10.725 | 11.034 | 0,06 |
| 3,450 % fällig am 01.03.2024 | | 10.600 | 11.071 | 0,06 |
| 3,850 % fällig am 15.05.2025 | | 6.242 | 6.645 | 0,03 |
| **Brambles USA, Inc.** | | | | |
| 5,350 % fällig am 01.04.2020 | | 200 | 205 | 0,00 |
| **Brandywine Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.02.2023 | | 2.317 | 2.404 | 0,01 |
| **Brighthouse Financial, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 22.06.2027 | | 4.900 | 4.660 | 0,02 |
| **Bristol-Myers Squibb Co.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 26.07.2024 | | 11.500 | 11.777 | 0,06 |
| 3,200 % fällig am 15.06.2026 | | 15.900 | 16.534 | 0,08 |
| 3,400 % fällig am 26.07.2029 | | 12.400 | 12.993 | 0,07 |
| **British Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,800 % fällig am 20.03.2033 | | 97 | 102 | 0,00 |
| 4,125 % fällig am 20.03.2033 | | 97 | 102 | 0,00 |
| **Brixmor Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.09.2023 | | 5.100 | 5.144 | 0,03 |
| 3,629 % fällig am 01.02.2022 | | 5.000 | 5.002 | 0,03 |
| 3,650 % fällig am 15.06.2024 | | 1.200 | 1.227 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 15.08.2022 | | 12.030 | 12.360 | 0,06 |
| **Broadcom Corp.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2020 | | 1.137 | 1.135 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2022 | | 35.900 | 36.007 | 0,18 |
| 3,125 % fällig am 15.01.2025 | | 19.200 | 18.778 | 0,09 |
| 3,500 % fällig am 15.01.2028 | | 10.800 | 10.263 | 0,05 |
| 3,625 % fällig am 15.01.2024 | | 2.300 | 2.323 | 0,01 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2021 | | 4.900 | 4.933 | 0,02 |
| 3,125 % fällig am 15.10.2022 | | 5.100 | 5.134 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 15.04.2026 | | 14.600 | 14.829 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 15.04.2029 | | 15.000 | 15.416 | 0,08 |
| **Camden Property Trust** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.09.2024 | | 800 | 834 | 0,00 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.03.2025 | | 3.000 | 3.123 | 0,02 |
| 4,800 % fällig am 15.03.2048 | | 2.800 | 2.838 | 0,01 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2024 | | 3.700 | 3.819 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | | 19.230 | 19.479 | 0,10 |
| **Capital One Financial Corp.** | | | | |
| 3,295 % fällig am 12.05.2020 | | 8.300 | 8.336 | 0,04 |
| **Carlyle Holdings Finance LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 30.03.2043 | | 100 | 109 | 0,00 |
| **CBL & Associates LP** | | | | |
| 4,600 % fällig am 15.10.2024 | | 2.100 | 1.417 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 01.12.2023 | | 400 | 290 | 0,00 |
| 5,950 % fällig am 15.12.2026 | | 6.300 | 4.347 | 0,02 |
| **Charles Schwab Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 10.03.2025 | | 3.200 | 3.279 | 0,02 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.02.2028 | | 38.000 | 38.304 | 0,19 |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | | 4.400 | 4.575 | 0,02 |
| 4,229 % fällig am 01.02.2024 | | 2.600 | 2.612 | 0,01 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 10.900 | 11.457 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 01.02.2024 | | 10.200 | 10.878 | 0,05 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 10.563 | 11.477 | 0,06 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 (b) | | 28.200 | 28.907 | 0,15 |
| 5,375 % fällig am 01.04.2038 | | 19.700 | 21.130 | 0,11 |
| 5,375 % fällig am 01.05.2047 | | 7.332 | 7.749 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 01.04.2048 | | 6.200 | 6.868 | 0,03 |
| **Cheniere Corpus Christi Holdings LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.06.2027 | | 9.600 | 10.452 | 0,05 |
| **Chubb INA Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 03.05.2026 | | 2.300 | 2.414 | 0,01 |
| **Churchill Downs, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 2.000 | 2.019 | 0,01 |
| **Cimarex Energy Co.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.06.2024 | | 4.109 | 4.355 | 0,02 |
| 4,375 % fällig am 15.03.2029 | | 15.500 | 16.494 | 0,08 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 07.03.2025 | | 2.100 | 2.307 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 09.03.2028 | | 1.900 | 2.166 | 0,01 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 12.02.2021 | $ | 2.900 | $ 2.925 | 0,01 |
| 3,123 % fällig am 20.05.2022 | | 14.000 | 14.023 | 0,07 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 30.03.2021 | | 19.045 | 19.149 | 0,10 |
| 3,531 % fällig am 24.07.2023 | | 18.700 | 18.765 | 0,09 |
| 3,540 % fällig am 25.04.2022 | | 9.100 | 9.180 | 0,05 |
| 3,543 % fällig am 01.06.2024 | | 18.700 | 18.813 | 0,09 |
| 3,569 % fällig am 01.07.2026 | | 5.900 | 5.947 | 0,03 |
| 3,710 % fällig am 30.03.2021 | | 10.000 | 10.165 | 0,05 |
| 3,766 % fällig am 02.08.2021 | | 3.400 | 3.446 | 0,02 |
| 4,075 % fällig am 23.04.2029 | | 30.800 | 33.113 | 0,17 |
| 8,125 % fällig am 15.07.2039 | | 580 | 929 | 0,00 |
| **Citizens Bank N.A.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 14.02.2022 | | 16.950 | 17.285 | 0,09 |
| 3,331 % fällig am 26.05.2022 | | 7.700 | 7.727 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 18.02.2026 | | 2.800 | 2.950 | 0,01 |
| **Cleco Corporate Holdings LLC** | | | | |
| 3,743 % fällig am 01.05.2026 | | 400 | 404 | 0,00 |
| **CME Group, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.06.2028 | | 3.300 | 3.599 | 0,02 |
| **CNH Industrial Capital LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.07.2019 | | 9.400 | 9.402 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 06.11.2020 | | 4.250 | 4.338 | 0,02 |
| **Comcast Cable Communications Holdings, Inc.** | | | | |
| 9,455 % fällig am 15.11.2022 | | 5.850 | 7.210 | 0,04 |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 2,350 % fällig am 15.01.2027 | | 3.300 | 3.221 | 0,02 |
| 2,759 % fällig am 01.10.2021 | | 2.337 | 2.347 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 01.03.2026 | | 10.200 | 10.565 | 0,05 |
| 3,300 % fällig am 01.02.2027 | | 5.200 | 5.415 | 0,03 |
| 3,375 % fällig am 15.08.2025 | | 3.500 | 3.664 | 0,02 |
| 3,700 % fällig am 15.04.2024 | | 13.800 | 14.656 | 0,07 |
| 3,950 % fällig am 15.10.2025 | | 7.500 | 8.098 | 0,04 |
| 3,999 % fällig am 01.11.2049 | | 4.500 | 4.753 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.03.2048 | | 3.300 | 3.496 | 0,02 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2021 | | 2.600 | 2.551 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 31.03.2023 | | 2.400 | 2.319 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2026 | | 5.300 | 5.113 | 0,03 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2024 | | 24.000 | 24.060 | 0,12 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.05.2024 | | 13.300 | 14.118 | 0,07 |
| 4,600 % fällig am 01.11.2025 | | 8.400 | 9.151 | 0,05 |
| 4,850 % fällig am 01.11.2028 | | 13.700 | 15.207 | 0,08 |
| 5,400 % fällig am 01.11.2048 | | 2.100 | 2.308 | 0,01 |
| **Concho Resources, Inc.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.08.2028 | | 17.400 | 18.752 | 0,09 |
| 4,375 % fällig am 15.01.2025 | | 2.000 | 2.079 | 0,01 |
| **Constellation Brands, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 06.11.2020 | | 1.900 | 1.896 | 0,01 |
| 3,200 % fällig am 15.02.2023 | | 17.700 | 18.108 | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 01.05.2023 | | 5.600 | 5.963 | 0,03 |
| **Continental Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,150 % fällig am 11.10.2025 | | 211 | 222 | 0,00 |
| 6,703 % fällig am 15.12.2022 | | 34 | 36 | 0,00 |
| 7,250 % fällig am 10.05.2021 | | 26.540 | 26.926 | 0,14 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 01.06.2024 | | 470 | 484 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.04.2023 | | 3.645 | 3.833 | 0,02 |
| **Cox Communications, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.12.2022 | | 9.200 | 9.397 | 0,05 |
| **CRH America Finance, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 04.04.2028 | | 5.523 | 5.652 | 0,03 |
| **CRH America, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 18.05.2025 | | 6.275 | 6.569 | 0,03 |
| **Crown Americas LLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2026 | | 3.300 | 3.399 | 0,02 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 01.09.2021 | | 1.000 | 996 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 15.07.2023 | | 4.000 | 4.080 | 0,02 |
| 3,700 % fällig am 15.06.2026 | | 1.100 | 1.143 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 15.02.2026 | | 25.359 | 27.375 | 0,14 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2023 | | 3.950 | 4.298 | 0,02 |
| **Crown Castle Towers LLC** | | | | |
| 3,720 % fällig am 15.07.2043 | | 8.900 | 9.176 | 0,05 |
| 4,241 % fällig am 15.07.2048 | | 6.200 | 6.688 | 0,03 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 4,100 % fällig am 25.03.2025 | $ | 48.400 | $ 51.081 | 0,26 |
| **CVS Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,704 % fällig am 10.01.2036 | | 252 | 268 | 0,00 |
| 7,507 % fällig am 10.01.2032 | | 1.702 | 2.057 | 0,01 |
| **CyrusOne LP** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.03.2027 | | 200 | 211 | 0,00 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.02.2020 | | 8.850 | 8.914 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2023 | | 6.521 | 7.151 | 0,04 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2020 | | 2.200 | 2.205 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | | 5.800 | 6.054 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 15.11.2021 | | 8.400 | 8.746 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 15.11.2023 | | 1.400 | 1.473 | 0,01 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 03.09.2019 | | 2.200 | 2.198 | 0,01 |
| 2,450 % fällig am 18.05.2020 | | 3.900 | 3.899 | 0,02 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2024 | | 39.100 | 40.151 | 0,20 |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 35.127 | 36.208 | 0,18 |
| 4,900 % fällig am 01.10.2026 | | 7.900 | 8.249 | 0,04 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 52.415 | 56.528 | 0,28 |
| 6,020 % fällig am 15.06.2026 | | 23.262 | 25.682 | 0,13 |
| **Delta Air Lines Pass-Through Trust** | | | | |
| 7,750 % fällig am 17.06.2021 | | 4.226 | 4.315 | 0,02 |
| **Diamond Resorts International, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | | 18.850 | 19.486 | 0,10 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | € | 11.700 | 14.556 | 0,07 |
| 2,625 % fällig am 15.04.2024 | | 8.000 | 10.006 | 0,05 |
| **Discover Bank** | | | | |
| 3,100 % fällig am 04.06.2020 | $ | 1.900 | 1.909 | 0,01 |
| **Discover Financial Services** | | | | |
| 4,100 % fällig am 09.02.2027 | | 10.565 | 11.015 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 30.01.2026 | | 11.400 | 12.252 | 0,06 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 20.09.2024 | £ | 9.500 | 12.220 | 0,06 |
| 4,125 % fällig am 15.05.2029 | $ | 3.000 | 3.127 | 0,02 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | | 3.800 | 3.828 | 0,02 |
| 6,750 % fällig am 01.06.2021 | | 21.467 | 22.567 | 0,11 |
| **Doctors Co.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.10.2023 | | 17.750 | 19.160 | 0,10 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | | 28.000 | 28.134 | 0,14 |
| **DriveTime Automotive Group, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.06.2021 | | 5.075 | 5.142 | 0,03 |
| **Duke Energy Corp.** | | | | |
| 3,028 % fällig am 14.05.2021 | | 21.600 | 21.659 | 0,11 |
| 3,101 % fällig am 11.03.2022 | | 9.300 | 9.350 | 0,05 |
| **Duquesne Light Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,400 % fällig am 15.09.2020 | | 1.522 | 1.588 | 0,01 |
| **E*TRADE Financial Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.06.2028 | | 6.000 | 6.315 | 0,03 |
| **Eaton Vance Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 06.04.2027 | | 1.000 | 1.035 | 0,01 |
| **Edison International** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.06.2027 | | 1.000 | 1.076 | 0,01 |
| **EMD Finance LLC** | | | | |
| 2,400 % fällig am 19.03.2020 | | 4.335 | 4.332 | 0,02 |
| 2,950 % fällig am 19.03.2022 | | 2.672 | 2.696 | 0,01 |
| **Emera U.S. Finance LP** | | | | |
| 2,700 % fällig am 15.06.2021 | | 8.300 | 8.331 | 0,04 |
| **Enable Midstream Partners LP** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.05.2024 | | 1.300 | 1.318 | 0,01 |
| 4,400 % fällig am 15.03.2027 | | 30.545 | 30.813 | 0,15 |
| 4,950 % fällig am 15.05.2028 | | 5.000 | 5.246 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2044 | | 7.307 | 6.829 | 0,03 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | | 2.829 | 2.878 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2023 | | 2.109 | 2.203 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2026 | | 29.767 | 31.923 | 0,16 |
| 5,150 % fällig am 01.02.2043 | | 2.494 | 2.513 | 0,01 |
| 5,150 % fällig am 15.03.2045 | | 6.050 | 6.162 | 0,03 |
| 6,050 % fällig am 01.06.2041 | | 8.500 | 9.534 | 0,05 |
| 6,125 % fällig am 15.12.2045 | | 5.405 | 6.133 | 0,03 |
| 6,250 % fällig am 15.04.2049 | $ | 450 | $ 534 | 0,00 |
| 6,625 % fällig am 15.10.2036 | | 1.820 | 2.121 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 01.07.2038 | | 8.384 | 10.675 | 0,05 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | | 5.637 | 5.796 | 0,03 |
| **Entergy Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2022 | | 1.661 | 1.729 | 0,01 |
| 5,125 % fällig am 15.09.2020 | | 18.659 | 19.101 | 0,10 |
| **Entergy Louisiana LLC** | | | | |
| 3,780 % fällig am 01.04.2025 | | 26.800 | 28.306 | 0,14 |
| **Entergy Mississippi LLC** | | | | |
| 2,850 % fällig am 01.06.2028 | | 2.200 | 2.204 | 0,01 |
| **Entergy New Orleans LLC** | | | | |
| 5,100 % fällig am 01.12.2020 | | 14.900 | 15.174 | 0,08 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 4,150 % fällig am 16.10.2028 | | 9.400 | 10.240 | 0,05 |
| 4,875 % fällig am 16.08.2077 | | 2.500 | 2.359 | 0,01 |
| 4,950 % fällig am 15.10.2054 | | 4.255 | 4.655 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 16.08.2077 | | 5.700 | 5.455 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 15.02.2078 | | 15.000 | 13.973 | 0,07 |
| 5,700 % fällig am 15.02.2042 | | 300 | 362 | 0,00 |
| **EPR Properties** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.04.2025 | | 6.000 | 6.284 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 01.06.2027 | | 200 | 209 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 15.12.2026 | | 2.525 | 2.674 | 0,01 |
| 4,950 % fällig am 15.04.2028 | | 16.200 | 17.440 | 0,09 |
| 5,250 % fällig am 15.07.2023 | | 3.800 | 4.070 | 0,02 |
| **EQM Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2024 | | 24.085 | 24.006 | 0,12 |
| 4,125 % fällig am 01.12.2026 | | 6.600 | 6.390 | 0,03 |
| **EQT Corp.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2020 | | 16.600 | 16.560 | 0,08 |
| 3,000 % fällig am 01.10.2022 | | 2.650 | 2.630 | 0,01 |
| 3,089 % fällig am 01.10.2020 | | 10.701 | 10.695 | 0,05 |
| 4,875 % fällig am 15.11.2021 | | 4.868 | 5.093 | 0,03 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | |
| 2,600 % fällig am 01.12.2021 | | 6.505 | 6.523 | 0,03 |
| 2,700 % fällig am 01.11.2023 | | 5.095 | 5.108 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 01.10.2020 | | 3.250 | 3.361 | 0,02 |
| **Essex Portfolio LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.05.2023 | | 350 | 357 | 0,00 |
| 3,375 % fällig am 15.04.2026 | | 1.900 | 1.944 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 01.04.2025 | | 900 | 930 | 0,00 |
| 3,625 % fällig am 15.08.2022 | | 3.665 | 3.777 | 0,02 |
| 3,625 % fällig am 01.05.2027 | | 4.300 | 4.470 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 01.05.2024 | | 7.500 | 7.869 | 0,04 |
| **Exelon Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.06.2020 | | 4.100 | 4.114 | 0,02 |
| **Fidelity National Financial, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.09.2022 | | 37.908 | 41.043 | 0,21 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 21.05.2027 | € | 2.200 | 2.617 | 0,01 |
| 2,602 % fällig am 21.05.2025 | £ | 4.800 | 6.288 | 0,03 |
| **First American Financial Corp.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.02.2023 | $ | 7.135 | 7.391 | 0,04 |
| 4,600 % fällig am 15.11.2024 | | 8.590 | 9.188 | 0,05 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.07.2022 | | 7.880 | 7.980 | 0,04 |
| **FirstEnergy Transmission LLC** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.01.2025 | | 9.357 | 10.049 | 0,05 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 01.07.2023 (b) | € | 3.800 | 4.357 | 0,02 |
| 1,125 % fällig am 01.07.2027 (b) | | 800 | 924 | 0,00 |
| 1,625 % fällig am 01.07.2030 (b) | | 9.400 | 10.965 | 0,06 |
| 2,250 % fällig am 01.07.2025 (b) | £ | 800 | 1.024 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2031 (b) | | 3.500 | 4.528 | 0,02 |
| 3,200 % fällig am 01.07.2026 | $ | 5.300 | 5.418 | 0,03 |
| **Flagstar Bancorp, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.07.2021 | | 21.500 | 22.686 | 0,11 |
| **Florida Gas Transmission Co. LLC** | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.07.2020 | | 6.200 | 6.362 | 0,03 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | € | 300 | 335 | 0,00 |
| 0,100 % fällig am 07.12.2022 | | 2.200 | 2.408 | 0,01 |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | | 700 | 789 | 0,00 |
| 1,514 % fällig am 17.02.2023 | | 13.500 | 15.483 | 0,08 |
| 2,343 % fällig am 02.11.2020 | $ | 31.943 | 31.726 | 0,16 |
| 2,459 % fällig am 27.03.2020 | | 4.800 | 4.787 | 0,02 |
| 2,597 % fällig am 04.11.2019 | $ | 200 | $ 200 | 0,00 |
| 3,006 % fällig am 02.11.2020 | | 600 | 594 | 0,00 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 13.600 | 16.425 | 0,08 |
| 3,200 % fällig am 15.01.2021 | $ | 3.200 | 3.211 | 0,02 |
| 3,336 % fällig am 18.03.2021 | | 9.800 | 9.854 | 0,05 |
| 3,408 % fällig am 05.04.2021 | | 10.368 | 10.235 | 0,05 |
| 3,753 % fällig am 15.02.2023 | | 19.000 | 18.453 | 0,09 |
| 5,875 % fällig am 02.08.2021 | | 5.700 | 6.012 | 0,03 |
| 8,125 % fällig am 15.01.2020 | | 1.500 | 1.543 | 0,01 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 5.000 | 5.162 | 0,03 |
| 6,750 % fällig am 15.03.2022 | | 8.600 | 8.955 | 0,05 |
| **Fortune Brands Home & Security, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2020 | | 17.200 | 17.259 | 0,09 |
| 4,000 % fällig am 15.06.2025 | | 4.400 | 4.633 | 0,02 |
| **Fox Corp.** | | | | |
| 4,030 % fällig am 25.01.2024 | | 6.800 | 7.238 | 0,04 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.11.2024 | | 11.665 | 9.974 | 0,05 |
| 8,250 % fällig am 15.04.2025 | | 17.400 | 15.051 | 0,08 |
| 10,750 % fällig am 01.04.2024 | | 5.400 | 5.049 | 0,03 |
| **Freeport Minerals Corp.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 01.06.2031 | | 300 | 372 | 0,00 |
| **Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 31.07.2019 | | 1.400 | 1.403 | 0,01 |
| **GATX Corp.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 30.07.2019 | | 1.920 | 1.920 | 0,01 |
| 3,285 % fällig am 05.11.2021 | | 2.600 | 2.590 | 0,01 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 17.05.2025 | € | 3.200 | 3.635 | 0,02 |
| 1,500 % fällig am 17.05.2029 | | 8.900 | 10.024 | 0,05 |
| 2,200 % fällig am 09.01.2020 | $ | 3.600 | 3.591 | 0,02 |
| 5,550 % fällig am 04.05.2020 | | 2.050 | 2.098 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 10.01.2039 | | 530 | 666 | 0,00 |
| **General Motors Co.** | | | | |
| 3,365 % fällig am 07.08.2020 | | 17.566 | 17.591 | 0,09 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 13.07.2020 | | 23.100 | 23.186 | 0,12 |
| 3,500 % fällig am 10.07.2019 | | 1.000 | 1.000 | 0,01 |
| 4,157 % fällig am 15.01.2020 | | 1.400 | 1.408 | 0,01 |
| **Glencore Funding LLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 12.03.2024 | | 10.300 | 10.701 | 0,05 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | | 11.300 | 12.221 | 0,06 |
| 5,375 % fällig am 15.04.2026 | | 6.000 | 6.504 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 01.06.2028 | | 12.600 | 13.932 | 0,07 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,307 % fällig am 09.09.2022 | € | 2.700 | 3.084 | 0,02 |
| 1,625 % fällig am 27.07.2026 | | 300 | 362 | 0,00 |
| 2,905 % fällig am 24.07.2023 | $ | 35.900 | 36.267 | 0,18 |
| 2,908 % fällig am 05.06.2023 | | 2.200 | 2.225 | 0,01 |
| 3,041 % fällig am 27.12.2020 | | 3.970 | 3.977 | 0,02 |
| 3,125 % fällig am 25.07.2029 | £ | 9.500 | 12.793 | 0,06 |
| 3,250 % fällig am 13.12.2019 | $ | 3.360 | 3.371 | 0,02 |
| 3,274 % fällig am 23.02.2023 | | 45.300 | 45.186 | 0,23 |
| 3,529 % fällig am 05.06.2023 | | 78.000 | 78.235 | 0,39 |
| 3,691 % fällig am 05.06.2028 | | 100 | 103 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 3.400 | 3.559 | 0,02 |
| 4,223 % fällig am 01.05.2029 | | 25.400 | 27.264 | 0,14 |
| **Goodman U.S. Finance Four LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.10.2037 | | 6.682 | 6.934 | 0,03 |
| **Goodman U.S. Finance Three LLC** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | | 14.975 | 15.159 | 0,08 |
| **GTP Acquisition Partners LLC** | | | | |
| 2,350 % fällig am 15.06.2045 | | 22.500 | 22.431 | 0,11 |
| **Guardian Life Global Funding** | | | | |
| 2,900 % fällig am 06.05.2024 | | 5.000 | 5.129 | 0,03 |
| **Gulfport Energy Corp.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.10.2024 | | 1.000 | 777 | 0,00 |
| **Gulfstream Natural Gas System LLC** | | | | |
| 4,600 % fällig am 15.09.2025 | | 5.500 | 5.935 | 0,03 |
| **Halliburton Co.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.11.2025 | | 100 | 105 | 0,00 |
| **Hanover Insurance Group, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2026 | | 6.140 | 6.503 | 0,03 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 15.09.2019 | | 1.100 | 1.099 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Harris Corp.** | | | | |
| 3,063 % fällig am 30.04.2020 | $ | 11.600 | $ 11.597 | 0,06 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2029 | | 11.000 | 11.330 | 0,06 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2022 | | 3.841 | 4.199 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2020 | | 18.250 | 18.671 | 0,09 |
| **HCP, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.12.2022 | | 9.200 | 9.636 | 0,05 |
| **Healthcare Trust of America Holdings LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.07.2021 | | 400 | 406 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 01.07.2027 | | 300 | 309 | 0,00 |
| **Helmerich & Payne, Inc.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 15.03.2025 | | 6.866 | 7.273 | 0,04 |
| **Highwoods Realty LP** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.04.2029 | | 4.300 | 4.496 | 0,02 |
| **Hospitality Properties Trust** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 9.295 | 9.751 | 0,05 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.04.2024 | | 8.700 | 8.955 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 15.06.2025 | | 1.725 | 1.788 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 01.03.2023 | | 4.000 | 4.240 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2021 | | 4.550 | 4.827 | 0,02 |
| **Huntsman International LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.05.2029 | | 10.415 | 10.758 | 0,05 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 3,396 % fällig am 03.04.2020 | | 6.300 | 6.318 | 0,03 |
| **Indiana Michigan Power Co.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.03.2023 | | 3.000 | 3.082 | 0,02 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.12.2025 | | 3.600 | 3.851 | 0,02 |
| **International Business Machines Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.05.2029 | | 2.300 | 2.409 | 0,01 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 29.394 | 31.723 | 0,16 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2022 | | 2.100 | 2.396 | 0,01 |
| **International Paper Co.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2041 | | 400 | 470 | 0,00 |
| **IPALCO Enterprises, Inc.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.07.2020 | | 9.800 | 9.864 | 0,05 |
| 3,700 % fällig am 01.09.2024 | | 7.318 | 7.582 | 0,04 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.03.2025 | € | 5.400 | 6.356 | 0,03 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.09.2022 (b) | $ | 7.200 | 7.209 | 0,04 |
| 2,650 % fällig am 21.06.2024 | | 7.800 | 7.844 | 0,04 |
| 3,250 % fällig am 30.01.2024 | | 10.200 | 10.513 | 0,05 |
| **JB Hunt Transport Services, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.03.2026 | | 9.700 | 10.167 | 0,05 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 03.06.2026 | | 2.900 | 2.933 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 15.08.2024 | | 6.900 | 6.811 | 0,03 |
| **Jeld-Wen, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.12.2025 | | 9.058 | 8.911 | 0,04 |
| 4,875 % fällig am 15.12.2027 | | 6.110 | 5.927 | 0,03 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 1,090 % fällig am 11.03.2027 | € | 1.400 | 1.648 | 0,01 |
| 3,012 % fällig am 18.06.2022 | $ | 1.100 | 1.102 | 0,01 |
| 3,220 % fällig am 01.03.2025 | | 12.400 | 12.758 | 0,06 |
| 3,482 % fällig am 23.07.2024 | | 24.600 | 24.690 | 0,12 |
| 3,509 % fällig am 23.01.2029 | | 29.200 | 30.382 | 0,15 |
| 3,559 % fällig am 23.04.2024 | | 66.500 | 68.983 | 0,35 |
| 3,702 % fällig am 06.05.2030 | | 5.500 | 5.804 | 0,03 |
| 3,782 % fällig am 01.02.2028 | | 12.969 | 13.759 | 0,07 |
| 3,797 % fällig am 23.07.2024 | | 29.800 | 31.271 | 0,16 |
| 4,203 % fällig am 23.07.2029 | | 300 | 328 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 15.10.2020 | | 3.100 | 3.177 | 0,02 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 2,970 % fällig am 19.10.2020 | | 9.200 | 9.208 | 0,05 |
| 3,086 % fällig am 26.04.2021 | | 1.400 | 1.408 | 0,01 |
| **Kansas City Southern** | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.06.2026 | | 7.500 | 7.360 | 0,04 |
| 4,950 % fällig am 15.08.2045 | | 500 | 551 | 0,00 |
| **Kentucky Utilities Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.11.2020 | | 5.400 | 5.447 | 0,03 |
| **Kerr-McGee Corp.** | | | | |
| 6,950 % fällig am 01.07.2024 | | 200 | 235 | 0,00 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.01.2023 | $ | 19.535 | $ 20.195 | 0,10 |
| 4,375 % fällig am 01.10.2025 | | 4.400 | 4.705 | 0,02 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.11.2040 | | 4.400 | 5.895 | 0,03 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.11.2023 | | 250 | 277 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2020 | | 23.352 | 24.449 | 0,12 |
| 7,420 % fällig am 15.02.2037 | | 3.700 | 4.519 | 0,02 |
| **Kinetic Concepts Inc.** | | | | |
| 12,500 % fällig am 01.11.2021 | | 3.675 | 4.056 | 0,02 |
| **KLA-Tencor Corp.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.11.2019 | | 2.118 | 2.122 | 0,01 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | | |
| 2,118 % fällig am 11.09.2020 | | 1.200 | 1.195 | 0,01 |
| 2,437 % fällig am 11.09.2022 | | 6.250 | 6.245 | 0,03 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 25.05.2028 | € | 11.525 | 14.053 | 0,07 |
| 3,115 % fällig am 10.02.2021 | $ | 13.330 | 13.309 | 0,07 |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 300 | 307 | 0,00 |
| 3,950 % fällig am 15.07.2025 | | 4.000 | 4.167 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 01.07.2027 | £ | 7.350 | 10.212 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 01.06.2046 | $ | 400 | 381 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 15.02.2025 | | 15.600 | 16.092 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 09.02.2040 | | 5.000 | 5.858 | 0,03 |
| **Lazard Group LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 11.03.2029 | | 10.000 | 10.577 | 0,05 |
| **Legg Mason, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.07.2024 | | 900 | 942 | 0,00 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 23.12.2010 ^ | | 900 | 16 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 12.06.2013 ^ | € | 2.807 | 72 | 0,00 |
| 6,875 % fällig am 02.05.2018 ^ | $ | 3.000 | 54 | 0,00 |
| **LG&E & KU Energy LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.11.2020 | | 2.000 | 2.030 | 0,01 |
| **Liberty Mutual Group, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 23.05.2059 | € | 3.100 | 3.617 | 0,02 |
| 4,569 % fällig am 01.02.2029 | $ | 800 | 880 | 0,00 |
| **Lifestorage LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2026 | | 15.200 | 15.213 | 0,08 |
| **LoanCore Capital Markets LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.06.2020 | | 17.250 | 17.175 | 0,09 |
| **Magellan Health, Inc.** | | | | |
| 4,900 % fällig am 22.09.2024 | | 24.100 | 23.895 | 0,12 |
| **Marathon Oil Corp.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.07.2027 | | 2.500 | 2.655 | 0,01 |
| **Marathon Petroleum Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.12.2026 | | 800 | 875 | 0,00 |
| **Marriott International, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.01.2022 | | 18.500 | 18.446 | 0,09 |
| 7,150 % fällig am 01.12.2019 | | 17.300 | 17.608 | 0,09 |
| **Marsh & McLennan Cos., Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 29.12.2020 | | 1.900 | 1.932 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 03.06.2024 | | 7.400 | 7.721 | 0,04 |
| 3,519 % fällig am 29.12.2021 | | 1.300 | 1.304 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 15.03.2024 | | 33.400 | 35.467 | 0,18 |
| 4,050 % fällig am 15.10.2023 | | 3.700 | 3.907 | 0,02 |
| **Masco Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2021 | | 14.500 | 14.720 | 0,07 |
| 5,950 % fällig am 15.03.2022 | | 14.156 | 15.321 | 0,08 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2020 | | 646 | 665 | 0,00 |
| **MassMutual Global Funding** | | | | |
| 1,950 % fällig am 22.09.2020 | | 5.000 | 4.991 | 0,03 |
| 2,500 % fällig am 17.10.2022 | | 5.436 | 5.481 | 0,03 |
| 3,400 % fällig am 08.03.2026 | | 6.000 | 6.289 | 0,03 |
| **Mercury General Corp.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.03.2027 | | 700 | 718 | 0,00 |
| **MetLife Capital Trust** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.12.2067 | | 3.282 | 4.141 | 0,02 |
| **MetLife, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2028 (g) | | 7.400 | 7.818 | 0,04 |
| **Metropolitan Edison Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.03.2023 | | 7.400 | 7.637 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 15.04.2025 | | 6.700 | 7.025 | 0,04 |
| **Metropolitan Life Global Funding** | | | | |
| 2,050 % fällig am 12.06.2020 | | 1.000 | 999 | 0,01 |
| **MGM Growth Properties Operating Partnership LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2028 | $ | 4.500 | $ 4.489 | 0,02 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.03.2023 | | 8.958 | 9.731 | 0,05 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | |
| 4,640 % fällig am 06.02.2024 | | 22.380 | 23.351 | 0,12 |
| **Mid-America Apartments LP** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.06.2027 | | 6.725 | 6.948 | 0,03 |
| 3,750 % fällig am 15.06.2024 | | 1.000 | 1.041 | 0,01 |
| 3,950 % fällig am 15.03.2029 | | 7.300 | 7.732 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 15.11.2025 | | 2.000 | 2.119 | 0,01 |
| 4,300 % fällig am 15.10.2023 | | 650 | 692 | 0,00 |
| **Midcontinent Express Pipeline LLC** | | | | |
| 6,700 % fällig am 15.09.2019 | | 16.420 | 16.578 | 0,08 |
| **Midwest Connector Capital Co. LLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2022 | | 8.000 | 8.200 | 0,04 |
| 3,900 % fällig am 01.04.2024 | | 17.800 | 18.536 | 0,09 |
| **Monongahela Power Co.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 15.05.2027 | | 24 | 25 | 0,00 |
| 4,100 % fällig am 15.04.2024 | | 1.000 | 1.068 | 0,01 |
| **Moody's Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.01.2028 | | 800 | 812 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 01.09.2022 | | 200 | 212 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 15.02.2024 | | 800 | 877 | 0,00 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 2,750 % fällig am 19.05.2022 | | 10.605 | 10.720 | 0,05 |
| 3,522 % fällig am 22.07.2022 | | 8.900 | 8.959 | 0,05 |
| 3,737 % fällig am 24.04.2024 | | 26.200 | 27.329 | 0,14 |
| 3,780 % fällig am 08.05.2024 | | 19.800 | 20.089 | 0,10 |
| **MPLX LP** | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.04.2058 | | 3.041 | 3.090 | 0,02 |
| **Mylan, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2023 | | 4.800 | 4.668 | 0,02 |
| 4,200 % fällig am 29.11.2023 | | 9.279 | 9.328 | 0,05 |
| 4,550 % fällig am 15.04.2028 | | 16.455 | 16.152 | 0,08 |
| **Nasdaq, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.06.2024 | | 800 | 857 | 0,00 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 30.06.2021 | | 9.700 | 9.727 | 0,05 |
| **Nationstar Mortgage Holdings, Inc.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.07.2023 | | 14.350 | 14.673 | 0,07 |
| **Nationwide Mutual Insurance Co.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.08.2039 | | 200 | 328 | 0,00 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 25.03.2021 | | 1.250 | 1.303 | 0,01 |
| 6,150 % fällig am 10.03.2021 | | 2.000 | 1.957 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 15.06.2022 | | 7.400 | 7.879 | 0,04 |
| 7,250 % fällig am 25.01.2022 | | 4.900 | 5.304 | 0,03 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 100 | 104 | 0,00 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2027 | € | 8.200 | 10.223 | 0,05 |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | | 13.600 | 16.816 | 0,08 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | $ | 1.700 | 1.810 | 0,01 |
| **Neuberger Berman Group LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2027 | | 14.000 | 14.783 | 0,07 |
| **Newell Brands, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 01.04.2026 | | 4.000 | 3.979 | 0,02 |
| **Newmark Group, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.11.2023 | | 10.300 | 10.906 | 0,05 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 15.09.2019 | | 850 | 850 | 0,00 |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | | 39.500 | 39.515 | 0,20 |
| 3,200 % fällig am 25.02.2022 | | 13.600 | 13.865 | 0,07 |
| **Niagara Mohawk Power Corp.** | | | | |
| 3,508 % fällig am 01.10.2024 | | 200 | 210 | 0,00 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 1,550 % fällig am 13.09.2019 | | 5.200 | 5.189 | 0,03 |
| 2,987 % fällig am 13.07.2020 | | 5.500 | 5.501 | 0,03 |
| 3,247 % fällig am 13.07.2022 | | 1.700 | 1.692 | 0,01 |
| 3,487 % fällig am 13.01.2022 | | 3.000 | 3.004 | 0,02 |
| **Northwest Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 7,041 % fällig am 01.10.2023 | | 324 | 353 | 0,00 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.06.2024 | | 3.500 | 3.599 | 0,02 |
| 4,450 % fällig am 15.06.2029 | | 1.500 | 1.563 | 0,01 |
| **Office Properties Income Trust** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2024 | | 1.900 | 1.895 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.08.2023 | $ | 200 | $ 208 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2025 | | 7.400 | 7.726 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2027 | | 500 | 523 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2026 | | 9.800 | 10.619 | 0,05 |
| **OMX Timber Finance Investments LLC** | | | | |
| 5,420 % fällig am 29.01.2020 | | 16.500 | 16.634 | 0,08 |
| **ONEOK Partners LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.09.2023 | | 9.280 | 10.031 | 0,05 |
| 6,125 % fällig am 01.02.2041 | | 1.000 | 1.180 | 0,01 |
| 6,850 % fällig am 15.10.2037 | | 2.775 | 3.436 | 0,02 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.03.2029 | | 30.000 | 32.090 | 0,16 |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | | 17.400 | 18.903 | 0,10 |
| 5,200 % fällig am 15.07.2048 | | 21.555 | 23.787 | 0,12 |
| 6,000 % fällig am 15.06.2035 | | 2.244 | 2.557 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 01.09.2023 | | 924 | 1.083 | 0,01 |
| **Oppenheimer Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.07.2022 | | 1.400 | 1.442 | 0,01 |
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 15.11.2024 | | 12.000 | 12.371 | 0,06 |
| 3,250 % fällig am 15.11.2027 | | 3.900 | 4.087 | 0,02 |
| **Owens Corning** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.08.2026 | | 4.638 | 4.521 | 0,02 |
| 4,200 % fällig am 15.12.2022 | | 8.787 | 9.151 | 0,05 |
| 4,200 % fällig am 01.12.2024 | | 6.602 | 6.864 | 0,03 |
| **Parsley Energy LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.10.2027 | | 2.700 | 2.835 | 0,01 |
| **PartnerRe Finance B LLC** | | | | |
| 3,700 % fällig am 02.07.2029 | | 12.000 | 12.229 | 0,06 |
| **Patterson-UTI Energy, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.02.2028 | | 20.778 | 20.513 | 0,10 |
| **Pennsylvania Electric Co.** | | | | |
| 6,150 % fällig am 01.10.2038 | | 3.290 | 4.090 | 0,02 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.07.2020 | | 100 | 100 | 0,00 |
| 3,900 % fällig am 01.02.2024 | | 1.000 | 1.047 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 29.01.2026 | | 5.000 | 5.367 | 0,03 |
| **Philip Morris International, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 19.03.2025 | € | 5.000 | 6.479 | 0,03 |
| **Physicians Realty LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.01.2028 | $ | 10.800 | 10.871 | 0,05 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2027 | | 1.600 | 1.653 | 0,01 |
| **Piedmont Natural Gas Co., Inc.** | | | | |
| 4,100 % fällig am 18.09.2034 | | 290 | 315 | 0,00 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.01.2021 | | 3.750 | 3.800 | 0,02 |
| 4,450 % fällig am 15.01.2026 | | 3.100 | 3.358 | 0,02 |
| 7,200 % fällig am 15.01.2028 | | 500 | 633 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 15.01.2020 | | 11.300 | 11.590 | 0,06 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.12.2019 | | 11.096 | 11.088 | 0,06 |
| 2,850 % fällig am 31.01.2023 | | 950 | 947 | 0,00 |
| 3,600 % fällig am 01.11.2024 | | 6.876 | 6.978 | 0,04 |
| 3,850 % fällig am 15.10.2023 | | 17.935 | 18.543 | 0,09 |
| 4,500 % fällig am 15.12.2026 | | 10.272 | 10.944 | 0,06 |
| 4,700 % fällig am 15.06.2044 | | 500 | 483 | 0,00 |
| 5,150 % fällig am 01.06.2042 | | 6.543 | 6.532 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2020 | | 1.000 | 1.014 | 0,01 |
| 6,650 % fällig am 15.01.2037 | | 8.692 | 10.110 | 0,05 |
| **PNC Bank N.A.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 21.07.2020 | | 3.300 | 3.311 | 0,02 |
| **Principal Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.05.2029 | | 800 | 837 | 0,00 |
| **Principal Life Global Funding** | | | | |
| 3,000 % fällig am 18.04.2026 | | 6.100 | 6.190 | 0,03 |
| **Progress Energy, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.03.2031 | | 750 | 1.052 | 0,01 |
| **Protective Life Global Funding** | | | | |
| 1,999 % fällig am 14.09.2021 | | 2.350 | 2.329 | 0,01 |
| 2,700 % fällig am 25.11.2020 | | 20.900 | 21.027 | 0,11 |
| **Provident Funding Associates LP** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.06.2025 | | 4.400 | 4.158 | 0,02 |
| **QUALCOMM, Inc.** | | | | |
| 3,070 % fällig am 20.05.2020 | | 8.100 | 8.133 | 0,04 |
| **Quicken Loans, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | | 30.600 | 30.562 | 0,15 |
| **QVC, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2023 | $ | 6.208 | $ 6.306 | 0,03 |
| 4,450 % fällig am 15.02.2025 | | 5.917 | 5.963 | 0,03 |
| 4,850 % fällig am 01.04.2024 | | 4.900 | 5.073 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 02.07.2022 | | 20.904 | 21.773 | 0,11 |
| **RBS Capital Trust** | | | | |
| 6,425 % fällig am 03.01.2034 (g) | | 1.100 | 1.405 | 0,01 |
| **Reckson Operating Partnership LP** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.03.2020 | | 1.800 | 1.864 | 0,01 |
| **Reinsurance Group of America, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.06.2021 | | 700 | 734 | 0,00 |
| **RELX Capital, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.10.2022 | | 1.000 | 1.019 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 16.03.2023 | | 8.600 | 8.887 | 0,04 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.06.2022 | | 1.700 | 1.766 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 12.06.2025 | | 6.550 | 6.951 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 01.05.2020 | | 1.000 | 1.035 | 0,01 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | | 1.900 | 2.138 | 0,01 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 5.016 | 5.612 | 0,03 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 271 | 313 | 0,00 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.07.2029 | | 7.800 | 8.091 | 0,04 |
| **Rockwell Collins, Inc.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.03.2022 | | 10.100 | 10.210 | 0,05 |
| 3,200 % fällig am 15.03.2024 | | 2.900 | 2.988 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 15.03.2027 | | 1.100 | 1.146 | 0,01 |
| **Ryder System, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 03.09.2019 | | 2.700 | 2.700 | 0,01 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 24.260 | 25.206 | 0,13 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 33.625 | 36.646 | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 16.555 | 18.422 | 0,09 |
| 5,875 % fällig am 30.06.2026 | | 3.000 | 3.431 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 15.03.2022 | | 720 | 782 | 0,00 |
| **salesforce.com, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 11.04.2023 | | 8.700 | 9.036 | 0,05 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | |
| 4,100 % fällig am 15.06.2049 | | 4.000 | 4.164 | 0,02 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 17.04.2020 | | 150 | 150 | 0,00 |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | | 6.600 | 6.702 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 07.06.2024 | | 12.800 | 13.010 | 0,07 |
| 4,400 % fällig am 13.07.2027 | | 400 | 418 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 17.07.2025 | | 5.600 | 5.965 | 0,03 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 3.400 | 3.387 | 0,02 |
| 3,097 % fällig am 15.01.2021 | | 1.400 | 1.396 | 0,01 |
| **Sierra Pacific Power Co.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 01.05.2026 | | 700 | 695 | 0,00 |
| **SL Green Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.10.2022 | | 2.686 | 2.723 | 0,01 |
| 3,505 % fällig am 16.08.2021 | | 4.100 | 4.102 | 0,02 |
| **SL Green Realty Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.12.2022 | | 22.400 | 23.525 | 0,12 |
| **SLM Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 05.04.2022 | | 6.850 | 6.816 | 0,03 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.08.2025 | | 6.294 | 6.513 | 0,03 |
| 6,650 % fällig am 01.04.2029 | | 6.000 | 6.874 | 0,03 |
| **Southern Co.** | | | | |
| 2,350 % fällig am 01.07.2021 | | 6.825 | 6.822 | 0,03 |
| **Southern Co. Gas Capital Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.10.2023 | | 600 | 599 | 0,00 |
| 4,400 % fällig am 30.05.2047 | | 200 | 212 | 0,00 |
| **Southern Power Co.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 15.12.2019 | | 4.700 | 4.686 | 0,02 |
| 2,500 % fällig am 15.12.2021 | | 7.592 | 7.606 | 0,04 |
| 2,937 % fällig am 20.12.2020 | | 2.700 | 2.701 | 0,01 |
| **Spectra Energy Partners LP** | | | | |
| 3,179 % fällig am 05.06.2020 | | 900 | 903 | 0,00 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.06.2026 | | 4.500 | 4.515 | 0,02 |
| 3,950 % fällig am 15.06.2023 | | 3.950 | 4.079 | 0,02 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2028 | | 17.700 | 18.586 | 0,09 |
| **Spirit Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,100 % fällig am 01.10.2029 | $ | 3.455 | $ 3.622 | 0,02 |
| **Spirit Realty LP** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.09.2026 | | 10.200 | 10.689 | 0,05 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.05.2022 | | 6.200 | 6.680 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | | 13.700 | 15.035 | 0,08 |
| 8,250 % fällig am 01.10.2023 | | 100 | 116 | 0,00 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 29.330 | 31.236 | 0,16 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 3,360 % fällig am 20.03.2023 | | 22.444 | 22.506 | 0,11 |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | | 21.400 | 22.256 | 0,11 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 9.800 | 9.751 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 15.02.2027 | | 12.014 | 12.194 | 0,06 |
| **State Street Corp.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 19.05.2021 | | 5.300 | 5.288 | 0,03 |
| **Stearns Holdings LLC** | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.08.2020 | | 20.708 | 19.776 | 0,10 |
| **STORE Capital Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.03.2029 | | 3.300 | 3.515 | 0,02 |
| **Sunoco Logistics Partners Operations LP** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.07.2026 | | 2.500 | 2.555 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.04.2024 | | 5.500 | 5.772 | 0,03 |
| 5,300 % fällig am 01.04.2044 | | 9.430 | 9.717 | 0,05 |
| 5,350 % fällig am 15.05.2045 | | 7.845 | 8.171 | 0,04 |
| 5,950 % fällig am 01.12.2025 | | 4.635 | 5.282 | 0,03 |
| **Synchrony Financial** | | | | |
| 3,806 % fällig am 03.02.2020 | | 15.500 | 15.563 | 0,08 |
| 3,950 % fällig am 01.12.2027 | | 5.500 | 5.499 | 0,03 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.10.2023 | | 10.600 | 10.786 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | 5.081 | 0,03 |
| **Teachers Insurance & Annuity Association of America** | | | | |
| 4,270 % fällig am 15.05.2047 | | 600 | 651 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 15.09.2054 | | 18.200 | 19.225 | 0,10 |
| **Tech Data Corp.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.02.2022 | | 12.240 | 12.455 | 0,06 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 31.01.2023 | | 2.100 | 2.108 | 0,01 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.09.2042 | | 800 | 749 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2020 | | 7.605 | 7.706 | 0,04 |
| **Time Warner Entertainment Co. LP** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.03.2023 | | 12.312 | 14.598 | 0,07 |
| 8,375 % fällig am 15.07.2033 | | 400 | 539 | 0,00 |
| **Times Square Hotel Trust** | | | | |
| 8,528 % fällig am 01.08.2026 | | 8.256 | 9.684 | 0,05 |
| **Tyson Foods, Inc.** | | | | |
| 2,972 % fällig am 21.08.2020 | | 6.300 | 6.300 | 0,03 |
| 3,070 % fällig am 02.06.2020 | | 2.200 | 2.203 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.03.2026 | | 8.400 | 8.941 | 0,04 |
| **U.S. Airways Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.05.2027 | | 402 | 424 | 0,00 |
| 5,375 % fällig am 15.05.2023 | | 373 | 389 | 0,00 |
| 5,900 % fällig am 01.04.2026 | | 1.354 | 1.495 | 0,01 |
| 7,125 % fällig am 22.04.2025 | | 2.989 | 3.370 | 0,02 |
| **U.S. Bancorp** | | | | |
| 0,850 % fällig am 07.06.2024 | € | 9.000 | 10.600 | 0,05 |
| **UDR, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.09.2026 | $ | 1.200 | 1.194 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2025 | | 10.197 | 10.848 | 0,05 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,875 % fällig am 07.04.2030 | | 644 | 640 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 01.09.2031 | | 15.918 | 16.297 | 0,08 |
| 3,700 % fällig am 01.09.2031 | | 6.829 | 6.927 | 0,03 |
| **United Technologies Corp.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 16.08.2023 | | 32.550 | 34.112 | 0,17 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | | 10.228 | 9.781 | 0,05 |
| **USAA Capital Corp.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.08.2020 | | 3.500 | 3.511 | 0,02 |
| **Valero Energy Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2029 | | 7.500 | 7.859 | 0,04 |
| **Ventas Realty LP** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 5.000 | 4.983 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **VEREIT Operating Partnership LP** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | $ | 5.200 | $ | 5.338 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 01.11.2025 | | 18.800 | | 20.261 | 0,10 |
| 4,875 % fällig am 01.06.2026 | | 1.900 | | 2.056 | 0,01 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | | |
| 3,618 % fällig am 15.05.2025 | | 19.800 | | 20.071 | 0,10 |
| 4,329 % fällig am 21.09.2028 | | 5.000 | | 5.546 | 0,03 |
| **Vistra Operations Co. LLC** | | | | | |
| 3,550 % fällig am 15.07.2024 | | 5.500 | | 5.539 | 0,03 |
| **VMware, Inc.** | | | | | |
| 2,300 % fällig am 21.08.2020 | | 500 | | 499 | 0,00 |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | | 58.331 | | 58.822 | 0,30 |
| 3,900 % fällig am 21.08.2027 | | 16.300 | | 16.549 | 0,08 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | | |
| 2,450 % fällig am 20.11.2019 | | 5.800 | | 5.798 | 0,03 |
| 3,475 % fällig am 12.11.2021 | | 200 | | 202 | 0,00 |
| **Voyager Aviation Holdings LLC** | | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.08.2021 | | 3.025 | | 3.078 | 0,02 |
| **Vulcan Materials Co.** | | | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2020 | | 3.430 | | 3.431 | 0,02 |
| **Wabtec Corp.** | | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.03.2024 | | 5.956 | | 6.310 | 0,03 |
| 4,950 % fällig am 15.09.2028 | | 5.000 | | 5.366 | 0,03 |
| **Walgreens Boots Alliance, Inc.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 20.11.2020 | £ | 4.500 | | 5.840 | 0,03 |
| **Walt Disney Co.** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 15.07.2024 | $ | 4.000 | | 5.332 | 0,03 |
| **Washington Prime Group LP** | | | | | |
| 3,850 % fällig am 01.04.2020 | | 400 | | 398 | 0,00 |
| 5,950 % fällig am 15.08.2024 (k) | | 40.500 | | 38.526 | 0,19 |
| **WEA Finance LLC** | | | | | |
| 3,150 % fällig am 05.04.2022 | | 6.100 | | 6.203 | 0,03 |
| 3,750 % fällig am 17.09.2024 | | 24.100 | | 25.170 | 0,13 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.07.2022 | | 3.200 | | 3.224 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 19.02.2025 | | 750 | | 763 | 0,00 |
| 3,196 % fällig am 17.06.2027 | | 5.900 | | 6.018 | 0,03 |
| 3,300 % fällig am 09.09.2024 | | 2.050 | | 2.123 | 0,01 |
| 3,465 % fällig am 11.02.2022 | | 17.628 | | 17.736 | 0,09 |
| 3,550 % fällig am 29.09.2025 | | 22.290 | | 23.305 | 0,12 |
| 3,584 % fällig am 22.05.2028 | | 40.100 | | 41.900 | 0,21 |
| 3,691 % fällig am 24.01.2023 | | 57.700 | | 58.424 | 0,29 |
| 3,750 % fällig am 24.01.2024 | | 17.600 | | 18.516 | 0,09 |
| 3,813 % fällig am 31.10.2023 | | 1.700 | | 1.733 | 0,01 |
| 3,843 % fällig am 04.03.2021 | | 19.300 | | 19.600 | 0,10 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | | | |
| 2,897 % fällig am 27.05.2022 | | 19.000 | | 19.184 | 0,10 |
| 3,102 % fällig am 22.10.2021 | | 10.500 | | 10.520 | 0,05 |
| 3,124 % fällig am 06.12.2019 | | 2.000 | | 2.006 | 0,01 |
| 3,141 % fällig am 27.05.2022 | | 9.850 | | 9.874 | 0,05 |
| 3,550 % fällig am 14.08.2023 | | 57.800 | | 60.369 | 0,30 |
| 3,625 % fällig am 22.10.2021 | | 12.300 | | 12.652 | 0,06 |
| **Welltower, Inc.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.04.2026 | | 2.400 | | 2.560 | 0,01 |
| 4,800 % fällig am 20.11.2028 | £ | 200 | | 301 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 15.01.2021 | $ | 1.200 | | 1.239 | 0,01 |
| **Western Digital Corp.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2026 | | 3.600 | | 3.541 | 0,02 |
| **Western Midstream Operating LP** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.06.2021 | | 200 | | 207 | 0,00 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2029 | | 23.200 | | 24.707 | 0,12 |
| 6,875 % fällig am 15.12.2033 | | 649 | | 868 | 0,00 |
| 6,950 % fällig am 01.10.2027 | | 3.604 | | 4.520 | 0,02 |
| 7,125 % fällig am 15.07.2023 | | 7.175 | | 8.330 | 0,04 |
| 7,375 % fällig am 15.03.2032 | | 17.544 | | 24.545 | 0,12 |
| 7,950 % fällig am 15.03.2025 | | 9.200 | | 11.195 | 0,06 |
| 8,500 % fällig am 15.01.2025 | | 31.727 | | 40.631 | 0,20 |
| **Willamette Industries, Inc.** | | | | | |
| 7,350 % fällig am 01.07.2026 | | 13.150 | | 16.056 | 0,08 |
| 9,000 % fällig am 01.10.2021 | | 10.150 | | 11.469 | 0,06 |
| **Williams Cos., Inc.** | | | | | |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | | 3.205 | | 4.565 | 0,02 |
| **WP Carey, Inc.** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.01.2023 | € | 3.000 | | 3.587 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.02.2025 | $ | 13.050 | | 13.490 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 01.10.2026 | | 1.200 | | 1.252 | 0,01 |
| 4,600 % fällig am 01.04.2024 | | 4.700 | | 4.965 | 0,03 |
| **WPX Energy, Inc.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.09.2024 | $ | 1.600 | $ | 1.650 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 01.06.2026 | | 2.700 | | 2.815 | 0,01 |
| **WRKCo, Inc.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.09.2024 | | 7.200 | | 7.274 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 15.03.2025 | | 12.000 | | 12.458 | 0,06 |
| 4,900 % fällig am 15.03.2029 | | 700 | | 766 | 0,00 |
| **Wyndham Destinations, Inc.** | | | | | |
| 5,400 % fällig am 01.04.2024 | | 3.500 | | 3.684 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 01.03.2021 | | 1.000 | | 1.037 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 01.04.2027 | | 9.150 | | 9.585 | 0,05 |
| 6,350 % fällig am 01.10.2025 | | 11.900 | | 13.016 | 0,07 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 30.05.2023 | | 27.010 | | 27.044 | 0,14 |
| **Yellowstone Energy LP** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.12.2026 | | 7.110 | | 7.384 | 0,04 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 29.04.2022 | | 4.653 | | 4.744 | 0,02 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | | |
| 1,414 % fällig am 13.12.2022 | € | 13.900 | | 16.419 | 0,08 |
| 2,700 % fällig am 01.04.2020 | $ | 29.051 | | 29.091 | 0,15 |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | | 12.397 | | 12.595 | 0,06 |
| 3,375 % fällig am 30.11.2021 | | 2.300 | | 2.341 | 0,01 |
| **Zoetis, Inc.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.02.2023 | | 4.085 | | 4.172 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 13.11.2025 | | 1.600 | | 1.757 | 0,01 |
| | | | | 7.034.643 | 35,26 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | | |
| **AECOM Technology Corp.** | | | | | |
| 4,152 % fällig am 13.03.2025 | | 5.425 | | 5.411 | 0,03 |
| **Altra Industrial Motion Corp.** | | | | | |
| 4,402 % fällig am 01.10.2025 | | 5.497 | | 5.404 | 0,03 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 4,330 % fällig am 30.04.2025 | | 4.828 | | 4.827 | 0,02 |
| **Crown Americas LLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 03.04.2025 | € | 2.673 | | 3.073 | 0,02 |
| **Diamond Resorts Corp.** | | | | | |
| 6,152 % fällig am 02.09.2023 | $ | 2.644 | | 2.506 | 0,01 |
| **Envision Healthcare Corp.** | | | | | |
| 6,152 % fällig am 10.10.2025 | | 10.348 | | 9.009 | 0,05 |
| **Fortress Investment Group LLC** | | | | | |
| 4,402 % fällig am 27.12.2022 | | 8.106 | | 8.110 | 0,04 |
| **HCA, Inc.** | | | | | |
| 4,330 % fällig am 13.03.2025 | | 13.778 | | 13.806 | 0,07 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | | | |
| 4,154 % fällig am 25.10.2023 | | 256 | | 257 | 0,00 |
| **Ineos Finance LLC** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 31.03.2024 | € | 11.525 | | 13.083 | 0,07 |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | | | |
| 4,152 % fällig am 27.03.2025 | $ | 213.570 | | 212.332 | 1,07 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | | |
| 4,652 % fällig am 22.02.2024 | | 8.000 | | 7.944 | 0,04 |
| **MGM Resorts International** | | | | | |
| 4,402 % fällig am 21.12.2023 | | 2.500 | | 2.491 | 0,01 |
| **MH Sub LLC** | | | | | |
| 6,152 % fällig am 13.09.2024 | | 21.025 | | 20.703 | 0,10 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | | | |
| 4,410 % fällig am 29.05.2025 | | 254 | | 253 | 0,00 |
| **NCI Building Systems, Inc.** | | | | | |
| 6,354 % fällig am 12.04.2025 | | 29.518 | | 28.780 | 0,14 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | | | |
| 4,412 % fällig am 04.10.2023 | | 2.253 | | 2.234 | 0,01 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | | |
| 6,904 % - 9,000 % fällig am 17.11.2025 | | 10.050 | | 10.017 | 0,05 |
| **RPI Finance Trust** | | | | | |
| 4,402 % fällig am 27.03.2023 | | 47.814 | | 47.916 | 0,24 |
| **SS&C Technologies, Inc.** | | | | | |
| 4,652 % fällig am 16.04.2025 | | 6.451 | | 6.435 | 0,03 |
| **TEX Operations Co. LLC** | | | | | |
| 4,402 % fällig am 04.08.2023 | | 3.861 | | 3.855 | 0,02 |
| **Western Digital Corp.** | | | | | |
| 3,902 % fällig am 27.02.2023 | | 2.599 | | 2.579 | 0,01 |
| **Wyndham Hotels & Resorts, Inc.** | | | | | |
| 4,152 % fällig am 30.05.2025 | $ | 3.573 | $ | 3.569 | 0,02 |
| | | | | 414.594 | 2,08 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | | |
| 6,725 % fällig am 01.04.2035 | | 100 | | 116 | 0,00 |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035 | | 500 | | 590 | 0,00 |
| **Metropolitan Transportation Authority, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | | |
| 6,814 % fällig am 15.11.2040 | | 8.700 | | 12.263 | 0,06 |
| **Metropolitan Water District of Southern California Revenue Bonds, (BABs), Series 2009** | | | | | |
| 5,906 % fällig am 01.07.2025 | | 3.700 | | 3.700 | 0,02 |
| **Michigan Tobacco Settlement Finance Authority Revenue Bonds, Series 2006** | | | | | |
| 7,309 % fällig am 01.06.2034 | | 3.470 | | 3.479 | 0,02 |
| **Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | | |
| 6,637 % fällig am 01.04.2057 | | 199 | | 239 | 0,00 |
| **New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured, New York Revenue Bonds, Series 2010** | | | | | |
| 5,267 % fällig am 01.05.2027 | | 2.200 | | 2.604 | 0,01 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007** | | | | | |
| 7,467 % fällig am 01.06.2047 | | 3.380 | | 3.413 | 0,02 |
| | | | | 26.404 | 0,13 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | | |
| 3,444 % fällig am 25.10.2046 | | 10.110 | | 9.116 | 0,05 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | | |
| 4,746 % fällig am 20.09.2034 | | 3 | | 3 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 4,305 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 93 | | 88 | 0,00 |
| 4,434 % fällig am 25.01.2035 | | 553 | | 556 | 0,00 |
| 4,673 % fällig am 25.02.2034 | | 12 | | 12 | 0,00 |
| 4,677 % fällig am 25.11.2034 | | 358 | | 357 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | | |
| 2,724 % fällig am 25.06.2046 ^ | | 4.295 | | 4.741 | 0,03 |
| 3,999 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 647 | | 590 | 0,00 |
| **BWAY Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,809 % fällig am 10.03.2033 | | 679 | | 688 | 0,00 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | | |
| 4,528 % fällig am 25.02.2037 | | 34 | | 35 | 0,00 |
| **Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates** | | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.10.2035 | | 167 | | 168 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | | |
| 4,550 % fällig am 25.09.2035 | | 51 | | 52 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 2,593 % fällig am 20.07.2046 ^ | | 7.927 | | 6.282 | 0,03 |
| 2,684 % fällig am 25.02.2037 | | 68 | | 63 | 0,00 |
| 2,714 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 1.029 | | 919 | 0,01 |
| 3,854 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 3.122 | | 2.844 | 0,02 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2047 ^ | | 858 | | 751 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 2,864 % fällig am 25.05.2035 | | 7 | | 7 | 0,00 |
| 4,075 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 585 | | 545 | 0,00 |
| 4,280 % fällig am 25.11.2034 | | 42 | | 43 | 0,00 |
| 4,592 % fällig am 20.02.2036 ^ | | 61 | | 54 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2034 | | 685 | | 704 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | | 95 | | 85 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 191 | | 185 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 | | 371 | | 360 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 53 | | 46 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 4,252 % fällig am 25.06.2033 | | 11 | | 11 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-through Certificates** | | | | | |
| 4,201 % fällig am 25.07.2033 | | 9 | | 10 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2033 | | 22 | | 24 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | | |
| 3,924 % fällig am 27.05.2037 | | 5.837 | | 4.707 | 0,02 |
| **DBUBS Mortgage Trust** | | | | | |
| 4,537 % fällig am 10.07.2044 | | 2.797 | | 2.893 | 0,02 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.07.2047 | $ 866 | $ 823 | 0,01 |
| **GSC Capital Corp. Mortgage Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.05.2036 ^ | 835 | 785 | 0,01 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,754 % fällig am 25.01.2036 | 3.057 | 2.682 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,040 % fällig am 25.04.2032 | 264 | 242 | 0,00 |
| 4,898 % fällig am 25.09.2035 | 3 | 3 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,580 % fällig am 19.08.2037 | 8.141 | 7.893 | 0,04 |
| 2,723 % fällig am 20.06.2035 | 2.840 | 2.838 | 0,02 |
| 4,656 % fällig am 19.04.2034 | 11 | 11 | 0,00 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 2,654 % fällig am 25.03.2035 | 722 | 633 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 3,104 % fällig am 25.03.2035 | 427 | 411 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,981 % fällig am 25.03.2036 | 1.277 | 1.175 | 0,01 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | |
| 5,658 % fällig am 26.05.2037 | 433 | 372 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 4,519 % fällig am 25.07.2035 | 50 | 51 | 0,00 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | |
| 5,750 % fällig am 25.02.2037 ^ | 2.464 | 2.224 | 0,01 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | |
| 4,663 % fällig am 21.11.2034 | 16 | 17 | 0,00 |
| **MASTR Alternative Loan Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.02.2034 | 31 | 33 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,654 % fällig am 25.11.2035 | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,784 % fällig am 25.08.2035 | 569 | 572 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.06.2028 | 2 | 2 | 0,00 |
| 3,240 % fällig am 25.01.2029 | 307 | 311 | 0,00 |
| 4,103 % fällig am 25.05.2036 | 789 | 738 | 0,00 |
| 4,879 % fällig am 25.05.2033 | 7 | 7 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 ^ | 72 | 60 | 0,00 |
| **MortgageIT Trust** | | | |
| 3,144 % fällig am 25.12.2034 | 260 | 261 | 0,00 |
| **NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates** | | | |
| 2,854 % fällig am 25.02.2035 ^ | 397 | 353 | 0,00 |
| **OBP Depositor LLC Trust** | | | |
| 4,646 % fällig am 15.07.2045 | 3.100 | 3.135 | 0,02 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 4,004 % fällig am 25.08.2035 | 383 | 369 | 0,00 |
| 4,940 % fällig am 25.03.2035 ^ | 125 | 117 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 5.162 | 4.777 | 0,03 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037 ^ | 2.323 | 1.139 | 0,01 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,583 % fällig am 20.05.2035 | 339 | 337 | 0,00 |
| 3,154 % fällig am 20.05.2034 | 1.116 | 1.130 | 0,01 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,226 % fällig am 25.04.2035 | 363 | 362 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 2,594 % fällig am 25.07.2046 ^ | 289 | 250 | 0,00 |
| 2,614 % fällig am 25.04.2036 | 357 | 349 | 0,00 |
| 2,614 % fällig am 25.05.2036 | 22 | 21 | 0,00 |
| 2,640 % fällig am 19.07.2035 | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.02.2036 ^ | 42 | 41 | 0,00 |
| 3,964 % fällig am 25.03.2046 | 432 | 443 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 4,413 % fällig am 25.06.2033 | 10 | 9 | 0,00 |
| 4,732 % fällig am 25.07.2033 | 478 | 492 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.12.2034 | 85 | 85 | 0,00 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 4,129 % fällig am 25.09.2037 | 31 | 32 | 0,00 |
| 4,131 % fällig am 25.09.2037 | 1.037 | 1.047 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 1,997 % fällig am 25.11.2041 | 226 | 225 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.12.2045 | 11 | 11 | 0,00 |
| 2,714 % fällig am 25.01.2045 | 44 | 44 | 0,00 |
| 2,774 % fällig am 25.05.2034 | 2.701 | 2.458 | 0,01 |
| 3,504 % fällig am 25.08.2046 | 16 | 15 | 0,00 |
| 4,458 % fällig am 25.03.2035 | 157 | 161 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,594 % fällig am 25.06.2037 | 5.873 | 5.578 | 0,03 |
| 3,344 % fällig am 25.11.2046 ^ | $ 3.885 | $ 3.523 | 0,02 |
| 4,278 % fällig am 25.06.2033 | 228 | 230 | 0,00 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,944 % fällig am 25.03.2037 ^ | 2.975 | 2.493 | 0,01 |
| 4,891 % fällig am 25.07.2037 ^ | 337 | 322 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,711 % fällig am 25.08.2036 ^ | 870 | 855 | 0,01 |
| 4,827 % fällig am 25.12.2033 | 14 | 15 | 0,00 |
| 4,973 % fällig am 25.12.2034 | 6 | 7 | 0,00 |
| | | 89.512 | 0,45 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Farm Credit Bank of Texas** | | | |
| 10,000 % fällig am 15.12.2020 (g)(j) | 4.000 | 4.420 | 0,02 |

| | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 2,754 % fällig am 25.05.2042 | $ 10 | 10 | 0,00 |
| 2,757 % fällig am 25.07.2037 | 5 | 5 | 0,00 |
| 2,827 % fällig am 25.09.2042 | 33 | 33 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.04.2032 | 2 | 2 | 0,00 |
| 3,682 % fällig am 01.06.2043 - 01.10.2044 | 33 | 33 | 0,00 |
| 4,230 % fällig am 01.12.2034 | 70 | 73 | 0,00 |
| 4,425 % fällig am 01.10.2036 | 3 | 3 | 0,00 |
| 4,670 % fällig am 01.09.2037 | 1 | 1 | 0,00 |
| 4,682 % fällig am 01.04.2037 | 1 | 1 | 0,00 |
| 4,689 % fällig am 01.03.2037 | 76 | 80 | 0,00 |
| 4,713 % fällig am 01.02.2037 | 1 | 1 | 0,00 |
| 4,776 % fällig am 01.09.2037 | 3 | 3 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2036 | 831 | 937 | 0,01 |
| 6,625 % fällig am 15.11.2030 | 18.125 | 25.935 | 0,13 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.06.2042 - 01.10.2046 | 110.136 | 112.003 | 0,56 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2045 | 8.357 | 8.679 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 01.05.2030 - 01.11.2041 | 607 | 633 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 106.800 | 107.601 | 0,54 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 1.622.700 | 1.658.909 | 8,32 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 479.000 | 495.022 | 2,48 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 3,488 % fällig am 25.02.2045 | 36 | 36 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 01.01.2040 | 87 | 93 | 0,00 |
| 4,765 % fällig am 01.10.2038 | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,813 % fällig am 01.06.2037 | 1 | 1 | 0,00 |
| 4,895 % fällig am 01.03.2036 | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,910 % fällig am 01.03.2036 | 1 | 1 | 0,00 |
| 4,961 % fällig am 01.03.2037 | 3 | 3 | 0,00 |
| 16,592 % fällig am 25.11.2055 | 6.649 | 3.986 | 0,02 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 3.000 | 3.109 | 0,02 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 4,720 % fällig am 01.02.2024 | 59 | 62 | 0,00 |
| 5,240 % fällig am 01.08.2023 | 59 | 61 | 0,00 |
| | | 2.417.322 | 12,12 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.02.2045 (k) | 30.650 | 30.542 | 0,15 |
| 2,500 % fällig am 15.05.2046 (k) | 43.483 | 43.242 | 0,22 |
| 2,750 % fällig am 15.08.2042 | 1.175 | 1.233 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2043 | 2.000 | 2.140 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2045 (k) | 91.888 | 98.230 | 0,49 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2049 | 401.795 | 431.114 | 2,16 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2044 (k) | 41.150 | 44.964 | 0,23 |
| 3,000 % fällig am 15.05.2045 (k) | 114.825 | 125.594 | 0,63 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 (k) | 6.032 | 6.603 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 15.02.2048 (k) | $ 198.492 | $ 217.492 | 1,09 |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049 | 763.474 | 838.658 | 4,20 |
| 3,125 % fällig am 15.02.2042 | 8.035 | 8.988 | 0,04 |
| 3,125 % fällig am 15.02.2043 | 1.200 | 1.339 | 0,01 |
| 3,125 % fällig am 15.08.2044 (k) | 178.125 | 198.769 | 1,00 |
| 3,125 % fällig am 15.05.2048 (k) | 29.523 | 33.134 | 0,17 |
| 3,375 % fällig am 15.11.2048 (k) | 90.719 | 106.809 | 0,53 |
| 4,375 % fällig am 15.05.2040 | 5.525 | 7.358 | 0,04 |
| 4,625 % fällig am 15.02.2040 | 1.950 | 2.678 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2030 | 45 | 64 | 0,00 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (f)** | | | |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 53.332 | 53.939 | 0,27 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | 79.752 | 80.332 | 0,40 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | 41.682 | 42.377 | 0,21 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | 42.474 | 43.511 | 0,22 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | 1.214 | 1.279 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 34.500 | 38.402 | 0,19 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | 20.826 | 25.064 | 0,13 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 31.05.2024 | 293.480 | 296.960 | 1,49 |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 (k) | 231.484 | 239.242 | 1,20 |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 | 125.286 | 132.135 | 0,66 |
| **U.S. Treasury STRIPS** | | | |
| 0,000 % fällig am 15.05.2043 (e) | 25 | 14 | 0,00 |
| | | 3.152.206 | 15,80 |
| Summe USA | | 13.269.792 | 66,52 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Gerdau Trade, Inc.** | | | |
| 4,875 % fällig am 24.10.2027 | 5.200 | 5.434 | 0,03 |
| **Global Switch Holdings Ltd.** | | | |
| 1,500 % fällig am 31.01.2024 | € 13.700 | 16.098 | 0,08 |
| **Studio City Finance Ltd.** | | | |
| 7,250 % fällig am 11.02.2024 | $ 5.100 | 5.319 | 0,03 |
| Summe Jungferninseln (Britisch) | | 26.851 | 0,14 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (l)** | | | |
| | | 1.390 | 0,01 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 1.390 | 0,01 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)** | 352.911 | 3.534 | 0,02 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 22.560.769** | **113,09** |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 265 | $ (161) | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 84 | 173 | 0,00 |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09/2019 | 81 | 70 | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 8.819 | 27.890 | 0,14 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 6.101 | 9.685 | 0,05 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 693 | 1.710 | 0,01 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09/2019 | 340 | (456) | 0,00 |
| | | | | $ 38.911 | 0,20 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 38.911** | **0,20** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Aetna, Inc. | (1,000) % | 20.12.2020 | $ 26.400 | $ 402 | 0,01 |
| Caterpillar, Inc. | (1,000) | 20.12.2020 | 14.150 | 91 | 0,00 |
| Deere & Co. | (1,000) | 20.12.2020 | 8.500 | 76 | 0,00 |
| Dow Chemical Co. | (1,000) | 20.12.2020 | 6.000 | 13 | 0,00 |
| ERP Operating LP | (1,000) | 20.12.2020 | 5.500 | 56 | 0,00 |
| | | | | $ 638 | 0,01 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatu | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Anadarko Petroleum Corp. | 1,000 % | 20.06.2021 | $ 1.800 | $ 83 | 0,00 |
| Anadarko Petroleum Corp. | 1,000 | 20.12.2021 | 24.050 | 1.622 | 0,01 |
| Anadarko Petroleum Corp. | 1,000 | 20.06.2022 | 300 | 6 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.12.2021 | 48.500 | 674 | 0,01 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.06.2022 | 29.900 | 1 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 63.800 | 205 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.06.2023 | 7.100 | 237 | 0,00 |
| Bombardier Inc. | 5,000 | 20.06.2024 | 1.000 | 9 | 0,00 |
| Canadian Natural Resources Ltd. | 1,000 | 20.06.2022 | 3.900 | 26 | 0,00 |
| Daimler AG | 1,000 | 20.12.2020 | € 16.500 | (32) | 0,00 |
| Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2019 | 11.000 | 0 | 0,00 |
| DISH DBS Corp. | 5,000 | 20.12.2022 | $ 12.650 | 99 | 0,00 |
| DISH DBS Corp. | 5,000 | 20.06.2023 | 8.600 | 355 | 0,00 |
| Enbridge, Inc. | 1,000 | 20.12.2021 | 2.500 | 154 | 0,00 |
| Enbridge, Inc. | 1,000 | 20.06.2022 | 26.500 | 173 | 0,00 |
| Exelon Generation Co. LLC | 1,000 | 20.06.2022 | 15.000 | 250 | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.12.2021 | 1.700 | (82) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.12.2022 | 200 | (14) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.06.2023 | 7.400 | (164) | 0,00 |
| Ford Motor Co. | 5,000 | 20.12.2023 | 8.100 | (375) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2021 | 18.200 | (1.344) | (0,01) |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2021 | 5.800 | (441) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2022 | 1.500 | (115) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2022 | 6.800 | (445) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2023 | 1.300 | (52) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2023 | 33.100 | 248 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 42.850 | 2.196 | 0,01 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 47.350 | 271 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 | 20.06.2020 | 48.900 | (445) | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 | 20.09.2020 | 7.700 | (65) | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 | 20.12.2020 | 6.100 | (47) | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 | 20.12.2021 | 9.300 | (40) | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 | 20.06.2022 | 6.700 | (15) | 0,00 |
| Hess Corp. | 1,000 | 20.12.2021 | 1.300 | 15 | 0,00 |
| Host Hotels & Resorts LP | 1,000 | 20.12.2020 | 3.300 | 16 | 0,00 |
| International Lease Finance Corp. | 5,000 | 20.12.2023 | 6.100 | 195 | 0,00 |
| Marks & Spencer PLC | 1,000 | 20.12.2023 | € 45.700 | 74 | 0,00 |
| MBIA, Inc. | 5,000 | 20.12.2019 | $ 11.200 | 1.645 | 0,01 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.09.2020 | 28.925 | 13 | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.09.2021 | 7.200 | 134 | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2021 | 34.100 | 1.066 | 0,01 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.06.2022 | 12.500 | (34) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 15.800 | (8) | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | 11.000 | 560 | 0,00 |
| Prudential Financial, Inc. | 1,000 | 20.09.2020 | 26.400 | 2 | 0,00 |

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Rolls-Royce PLC | 1,000% | 20.12.2021 | € 22.100 | $ (97) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2023 | 13.300 | 149 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2024 | 5.600 | 29 | 0,00 |
| Ryder System, Inc. | 1,000 | 20.06.2022 | $ 9.400 | (89) | 0,00 |
| Sherwin-Williams Co. | 1,000 | 20.06.2022 | 5.900 | (14) | 0,00 |
| Sherwin-Williams Co. | 1,000 | 20.12.2022 | 17.800 | (31) | 0,00 |
| Simon Property Group LP | 1,000 | 20.06.2022 | 6.300 | 17 | 0,00 |
| Telefonica Emisiones S.A.U. | 1,000 | 20.12.2023 | € 16.900 | 431 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 3.000 | 7 | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2023 | € 26.100 | 446 | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2024 | 12.700 | 121 | 0,00 |
| | | | | $ 7.580 | 0,04 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-31 5-Year Index | (5,000)% | 20.12.2023 | $ 17.557 | $ (169) | 0,00 |
| CDX.HY-32 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2024 | 25.100 | (161) | 0,00 |
| iTraxx Europe Main 28 5-Year Index | (1,000) | 20.12.2022 | € 439.200 | (1.020) | (0,01) |
| | | | | $ (1.350) | (0,01) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000% | 20.06.2024 | $ 368.400 | $ 3.804 | 0,02 |
| CDX.IG-31 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2023 | 164.300 | 1.385 | 0,01 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 1.159.400 | 3.035 | 0,01 |
| iTraxx Europe Main 31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | € 3.200 | 18 | 0,00 |
| | | | | $ 8.242 | 0,04 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,300% | 13.12.2047 | CAD 1.200 | $ (126) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,500 | 19.06.2025 | 1.000 | 11 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,738 | 31.01.2048 | 2.300 | (296) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,880 | 02.07.2019 | $ 70.300 | (290) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,940 | 02.07.2019 | 81.500 | (558) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 27.06.2024 | 70.300 | (641) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 28.06.2024 | 81.300 | (742) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,050 | 19.06.2024 | 69.500 | (846) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,060 | 21.06.2024 | 69.600 | (890) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,080 | 20.06.2024 | 71.200 | (990) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,080 | 26.06.2024 | 70.100 | (979) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,090 | 24.06.2024 | 69.500 | (1.000) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,100 | 18.06.2024 | 69.500 | (1.020) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,110 | 25.06.2024 | 70.200 | (1.080) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,160 | 12.06.2024 | 80.700 | (1.414) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,190 | 11.06.2024 | 71.200 | (1.357) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,200 | 05.06.2024 | 69.500 | (1.352) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,210 | 04.06.2024 | 69.400 | (1.387) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,210 | 12.06.2024 | 69.100 | (1.385) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,220 | 30.05.2024 | 69.400 | (1.400) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,220 | 10.06.2024 | 77.400 | (1.582) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,240 | 29.05.2024 | 71.000 | (1.508) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,240 | 31.05.2024 | 77.500 | (1.656) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 30.05.2024 | 68.900 | (1.495) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 156.200 | (16.587) | (0,08) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,270 | 06.06.2024 | 71.800 | (1.655) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 15.05.2024 | 76.900 | (1.819) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 28.05.2024 | 79.900 | (1.895) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 05.06.2024 | 71.500 | (1.716) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 17.05.2024 | 71.000 | (1.714) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 22.05.2024 | 80.500 | (1.948) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,310 | 24.05.2024 | 79.800 | (1.966) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,320 | 21.05.2024 | 80.600 | (2.019) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,330 | 20.05.2024 | 80.400 | (2.058) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,410 | 11.04.2024 | 70.000 | (2.016) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,425 | 15.04.2024 | 109.800 | (3.245) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,435 | 10.04.2024 | 71.900 | (2.148) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,475 | 10.04.2024 | 74.600 | (2.365) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,480 | 02.04.2024 | 3.100 | (99) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,490 | 03.04.2024 | 75.700 | (2.449) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 208.900 | (29.199) | (0,15) |

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,510 % | 08.04.2024 | $ 78.000 | $ (2.600) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,510 | 09.04.2024 | 68.300 | (2.287) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,933 | 15.08.2048 | 33.800 | (6.147) | (0,03) |
| Zahlung[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | £ 150.500 | 3.219 | 0,02 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2029 | 48.700 | (2.314) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 71.000 | (7.291) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,750 | 21.09.2066 | 2.000 | (199) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,000 | 19.09.2023 | HUF 37.770.400 | 2.225 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,250 | 19.09.2023 | 16.157.700 | 896 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 20.03.2028 | ¥ 7.992.900 | (2.087) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,415 | 25.03.2029 | 2.120.000 | (766) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 20.03.2029 | 17.300.000 | (6.272) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 | 18.09.2023 | 890.000 | (15) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 | 20.09.2024 | 1.830.000 | (305) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 1,250 | 17.06.2035 | 2.530.000 | (1.577) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 1,500 | 21.12.2045 | 470.000 | (639) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,850 | 17.04.2024 | MXN 3.248.400 | 3.921 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,038 | 29.02.2024 | 721.100 | 1.152 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,900 | 27.11.2023 | 2.358.900 | 7.490 | 0,04 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,273 | 30.09.2020 | $ 650 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | UKRPI | 3,530 | 15.10.2031 | £ 60.800 | (707) | 0,00 |
| | | | | | $ (113.185) | (0,57) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (98.075)** | **(0,49)** |

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

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,107 % | 12.09.2019 | 857.700 | $ 4.034 | $ 23.415 | 0,12 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,940 | 18.02.2020 | 455.700 | 3.342 | 11.681 | 0,06 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,258 | 18.09.2019 | 54.300 | 1.618 | 1 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,945 | 09.12.2019 | 56.300 | 2.702 | 101 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,945 | 11.12.2019 | 24.700 | 1.166 | 46 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,258 | 18.09.2019 | 45.000 | 1.365 | 1 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,340 | 04.10.2019 | 55.000 | 1.553 | 1 | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 10.09.2019 | 676.100 | 3.120 | 17.693 | 0,09 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,120 | 13.09.2019 | 720.600 | 3.326 | 19.864 | 0,10 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,258 | 18.09.2019 | 31.600 | 980 | 1 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,930 | 09.12.2019 | 81.600 | 3.753 | 159 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,943 | 12.12.2019 | 24.700 | 1.186 | 48 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,630 | 16.12.2019 | 27.300 | 1.570 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 29.715 | $ 73.012 | 0,37 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 55.000 | $ (52) | $ (4) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 43.600 | (52) | (8) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 60.300 | (57) | (15) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 | 21.08.2019 | 72.300 | (62) | (17) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 50.800 | (46) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 132.500 | (177) | (33) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 82.000 | (91) | (10) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 53.600 | (62) | (14) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 193.360 | (328) | (57) | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 21.08.2019 | 143.600 | $ (139) | (33) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 46.300 | (47) | (7) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 18.09.2019 | 182.500 | (413) | (73) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 182.500 | (355) | (62) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 76.700 | (121) | (20) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 46.000 | (51) | (14) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 51.500 | (77) | (13) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 49.000 | (57) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 19.200 | (21) | (4) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 38.000 | (65) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,800 | 17.07.2019 | 72.000 | (67) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 84.600 | (84) | (16) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 62.400 | (73) | (19) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 2,900 | 17.06.2020 | 89.200 | (80) | (22) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 36.600 | (71) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 327.840 | (518) | (96) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 3,000 | 17.06.2020 | 97.900 | (99) | (22) | 0,00 |
| JLN | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 42.800 | (68) | (13) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 71.900 | (122) | (18) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 41.200 | (41) | (8) | 0,00 |
| | | | | | | $ (3.496) | $ (620) | (0,01) |

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Floor -OTC CPURNSA | $ 215,949 | Maximal [1 + 0,000 %[10] - (Index Final/Index Initial)] oder 0 | 12.03.2020 | 34.300 | $ (295) | $ 0 | 0,00 |
| | Floor -OTC CPURNSA | 217,965 | Maximal [(1 + 0,000 %)[10] - (Index Final/Index Initial)] oder 0 | 29.09.2020 | 28.500 | (368) | 0 | 0,00 |
| DUB | Floor -OTC CPURNSA | 218,011 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 13.10.2020 | 23.600 | (231) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (894) | $ 0 | 0,00 |

## ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nenn-betrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,940 % | 18.09.2019 | 232.700 | $ (1.651) | $ (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 09.12.2019 | 247.700 | (2.706) | (25) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 11.12.2019 | 108.600 | (1.165) | (12) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,100 | 12.09.2019 | 188.500 | (4.034) | (19.504) | (0,10) |
| | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,086 | 18.02.2020 | 43.400 | (3.342) | (8.310) | (0,04) |
| DUB | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,940 | 18.09.2019 | 193.500 | (1.365) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,040 | 04.10.2019 | 221.200 | (1.487) | (1) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,790 | 11.07.2019 | 70.400 | (118) | (270) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,070 | 11.07.2019 | 70.400 | (91) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,940 | 18.09.2019 | 135.900 | (988) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 09.12.2019 | 359.000 | (3.769) | (37) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 12.12.2019 | 108.600 | (1.185) | (12) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 16.12.2019 | 120.000 | (1.568) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,990 | 12.07.2019 | 36.500 | (93) | (212) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,230 | 12.07.2019 | 36.500 | (88) | (5) | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,055 | 10.09.2019 | 148.600 | (3.121) | (14.761) | (0,08) |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,100 | 13.09.2019 | 158.400 | (3.326) | (16.385) | (0,08) |
| MYC | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,880 | 01.07.2019 | 82.900 | (128) | (493) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,160 | 01.07.2019 | 82.900 | (124) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (30.349) | $ (60.032) | (0,30) |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 % | 20.06.2020 | $ 5.000 | $ (278) | $ 7 | $ (271) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 6.650 | (128) | 129 | 1 | 0,00 |
| | New York State General Obligation Bonds, Series 2005 | 1,850 | 20.03.2021 | 1.800 | 0 | 55 | 55 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2023 | 4.600 | (470) | 400 | (70) | 0,00 |
| BPS | BHP Billiton Finance USA Ltd. | 1,000 | 20.06.2021 | 5.100 | (156) | 243 | 87 | 0,00 |
| | Hammerson PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 5.000 | 53 | (7) | 46 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | $ 8.750 | (177) | 179 | 2 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 4.200 | (68) | 48 | (20) | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.09.2020 | 23.500 | (1.173) | 851 | (322) | 0,00 |
| BRC | Hammerson PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 9.500 | 86 | 2 | 88 | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | $ 900 | (12) | 22 | 10 | 0,00 |
| CBK | AXA Equitable Holdings, Inc. | 1,000 | 20.06.2023 | 8.700 | (237) | 181 | (56) | 0,00 |
| | Bausch Health Companies, Inc. | 5,000 | 20.12.2020 | 4.500 | 115 | 195 | 310 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 500 | (3) | 7 | 4 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 18.000 | (313) | 226 | (87) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2023 | 7.900 | (762) | 643 | (119) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 7.900 | (659) | 682 | 23 | 0,00 |
| DUB | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.09.2020 | 12.800 | (689) | 514 | (175) | 0,00 |

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | American Tower Corp. | 1,000 % | 20.06.2021 | $ 17.500 | $ (826) | $ 826 | $ 0 | 0,00 |
| | Enterprise Products Operating LLC | 1,000 | 20.06.2021 | 7.000 | (361) | 470 | 109 | 0,00 |
| | Hammerson PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 500 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | $ 2.500 | (34) | 62 | 28 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 2.900 | (22) | 38 | 16 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2023 | 23.500 | (2.524) | 2.168 | (356) | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.09.2020 | 9.500 | (464) | 334 | (130) | 0,00 |
| HUS | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 1.200 | (16) | 29 | 13 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 2.500 | (37) | 63 | 26 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 34.150 | (538) | 546 | 8 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 45.900 | (739) | 516 | (223) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2023 | 2.400 | (269) | 233 | (36) | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.09.2020 | 19.700 | (983) | 713 | (270) | 0,00 |
| JPM | AP Moller - Maersk | 1,000 | 20.06.2022 | € 12.800 | (72) | 208 | 136 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | $ 21.200 | (306) | 525 | 219 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 10.600 | (201) | 203 | 2 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.500 | (24) | 17 | (7) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2023 | 14.200 | (1.347) | 1.132 | (215) | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.09.2020 | 24.500 | (1.279) | 943 | (336) | 0,00 |
| | Southern Co. | 1,000 | 20.12.2022 | 23.000 | 285 | 217 | 502 | 0,00 |
| | Springleaf Finance Corp. | 5,000 | 20.12.2021 | 200 | (8) | 28 | 20 | 0,00 |
| MYC | American Tower Corp. | 1,000 | 20.06.2020 | 3.200 | (112) | 122 | 10 | 0,00 |
| | Enterprise Products Operating LLC | 1,000 | 20.06.2021 | 33.200 | (1.140) | 1.656 | 516 | 0,00 |
| NGF | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 800 | (5) | 5 | 0 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 7.900 | (651) | 674 | 23 | 0,00 |
| UAG | Avolon Holdings Ltd. | 5,000 | 01.07.2020 | 7.400 | 433 | (126) | 307 | 0,00 |
| | | | | | $ (16.106) | $ 15.979 | $ (127) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | CDX.HY-25 5-Year Index 25-35 % | 5,000 % | 20.12.2020 | $ 3.300 | $ 30 | $ 214 | $ 244 | 0,00 |
| | CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2021 | 7.100 | 1.079 | (243) | 836 | 0,00 |
| BPS | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 5.800 | 676 | 237 | 913 | 0,00 |
| BRC | iTraxx Japan 31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | ¥ 6.986.000 | 1.309 | (54) | 1.255 | 0,01 |
| CBK | CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2021 | $ 29.550 | 2.782 | 699 | 3.481 | 0,02 |
| | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 8.000 | 828 | 432 | 1.260 | 0,01 |
| | iTraxx Japan 31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | ¥ 1.553.000 | 288 | (9) | 279 | 0,00 |
| DUB | iTraxx Japan 31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 3.830.000 | 720 | (32) | 688 | 0,00 |
| GST | CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2021 | $ 13.500 | 1.141 | 449 | 1.590 | 0,01 |
| | CDX.HY-29 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2022 | 6.000 | 832 | 61 | 893 | 0,00 |
| | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 24.000 | 2.849 | 931 | 3.780 | 0,02 |
| | iTraxx Japan 31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | ¥ 4.770.000 | 891 | (34) | 857 | 0,00 |
| JPM | CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2021 | $ 3.550 | 304 | 114 | 418 | 0,00 |
| | CDX.HY-29 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2022 | 4.900 | 779 | (50) | 729 | 0,00 |
| | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 44.300 | 5.450 | 1.527 | 6.977 | 0,04 |
| | iTraxx Japan 31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | ¥ 17.654.000 | 3.298 | (127) | 3.171 | 0,02 |
| MYC | CDX.HY-25 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2020 | $ 15.000 | 75 | 1.035 | 1.110 | 0,01 |
| | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 6.600 | 784 | 255 | 1.039 | 0,01 |
| | | | | | $ 24.115 | $ 5.405 | $ 29.520 | 0,15 |

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

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

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 36.188 | $ | 40.436 | $ 0 | $ (776) | $ (776) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 18.019 | AUD | 25.802 | 88 | 0 | 88 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 168.805 | CAD | 222.029 | 1.104 | 0 | 1.104 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 8.032 | CHF | 8.056 | 231 | 0 | 231 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.341.381 | € | 2.060.349 | 4.946 | 0 | 4.946 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 1.116 | £ | 878 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 25.802 | $ | 18.038 | 0 | (89) | (89) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 222.029 | | 168.927 | 0 | (1.107) | (1.107) | (0,01) |
| | 08/2019 | € | 2.060.349 | | 2.347.348 | 0 | (4.975) | (4.975) | (0,02) |
| BPS | 07/2019 | | 18.101 | | 20.639 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 21.823 | | 14.557 | 0 | (101) | (101) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.039 | ARS | 152.721 | 432 | 0 | 432 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 30.850 | € | 27.503 | 470 | 0 | 470 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 7.719 | £ | 6.079 | 25 | (8) | 17 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.330 | TRY | 7.871 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |

## Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | ARS | 395.519 | $ | 8.862 | $ 9 | $ 0 | $ 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 36.205 | MXN | 721.666 | 1.097 | 0 | 1.097 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 14.566 | NZD | 21.823 | 102 | 0 | 102 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 382.630 | $ | 324 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 721.666 | | 35.815 | 0 | (1.100) | (1.100) | (0,01) |
| BRC | 07/2019 | $ | 16.492 | £ | 13.018 | 76 | 0 | 76 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 25.802 | $ | 17.862 | 0 | (244) | (244) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 533.071 | | 675.425 | 0 | (3.014) | (3.014) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 1.684.230 | | 15.459 | 0 | (173) | (173) | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 13.773 | | 4.147 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.453 | CAD | 3.320 | 88 | 0 | 88 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 750.555 | £ | 590.770 | 1.318 | 0 | 1.318 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 14.319 | PEN | 47.194 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 567.551 | $ | 722.234 | 0 | (1.212) | (1.212) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 3.790 | MXN | 73.239 | 0 | (5) | (5 | 0,00 |
| | 09/2019 | PEN | 447.194 | $ | 134.410 | 0 | (1.173) | (1.173) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 14.072 | COP | 47.341.050 | 612 | 0 | 612 | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 46.995 | $ | 13.911 | 0 | (316) | (316) | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 4.326 | MXN | 84.870 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| FBF | 09/2019 | | 220 | INR | 15.434 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 5.796 | € | 5.129 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.198 | HUF | 1.189.321 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 15.061 | PLN | 56.282 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 23.089 | ZAR | 327.659 | 130 | 0 | 130 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 98.799 | BRL | 382.589 | 748 | 0 | 748 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.501 | RUB | 164.681 | 88 | 0 | 88 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 24.170 | COP | 81.820.766 | 1.210 | 0 | 1.210 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 60.340 | IDR | 885.494.625 | 1.741 | 0 | 1.741 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 143 | THB | 4.486 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 33.477 | MXN | 653.921 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | ARS | 832.722 | $ | 16.780 | 0 | (2.049) | (2.049) | (0,01) |
| | 07/2019 | CAD | 225.349 | | 167.171 | 0 | (5.279) | (5.279) | (0,03) |
| | 07/2019 | CHF | 8.092 | | 8.282 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 3.569 | | 4.061 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 2.254 | | 2.858 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07/2019 | HKD | 2.310 | | 296 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 33.421 | | 10.061 | 0 | (98) | (98) | 0,00 |
| | 07/2019 | SGD | 461 | | 340 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 7.685 | ARS | 386.015 | 1.046 | 0 | 1.046 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 46 | € | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 92 | £ | 72 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 535 | HUF | 154.490 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 85.529 | RUB | 5.668.541 | 4.173 | 0 | 4.173 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 105 | SGD | 141 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 8.270 | CHF | 8.056 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.408 | MXN | 27.084 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 874 | | 17.125 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 759 | $ | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | € | 25.474 | | 28.537 | 0 | (473) | (473) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 3.815 | | 4.846 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | HUF | 2.009.884 | | 7.303 | 207 | 0 | 207 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 5.763 | € | 5.097 | 42 | 0 | 42 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.286 | £ | 1.814 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 32.079 | PLN | 120.076 | 132 | 0 | 132 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 660 | MXN | 12.837 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 2.613 | $ | 83 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | € | 2.018.331 | | 2.256.898 | 0 | (41.578) | (41.578) | (0,21) |
| | 07/2019 | £ | 190 | | 241 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 210 | € | 185 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 14.243 | NZD | 21.823 | 415 | 0 | 415 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.827 | ZAR | 41.438 | 110 | 0 | 110 | 0,00 |
| SCX | 09/2019 | SGD | 221 | $ | 162 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | $ | 2.278 | PLN | 8.574 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 23.097 | ZAR | 335.946 | 709 | 0 | 709 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | £ | 73.881 | $ | 93.353 | 0 | (676) | (676 | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 408.200 | | 3.780 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 494 | HUF | 140.843 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 12.719 | $ | 1.625 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| TOR | 08/2019 | $ | 18.493 | MXN | 357.690 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 19.440 | ¥ | 2.092.430 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 2.092.430 | $ | 19.486 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 31.604 | | 4.556 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | | | | | | $ 21.632 | $ (64.646) | $ (43.014) | (0,22) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die ausschüttende Investor AUD (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 | 07/2019 | AUD | 1.361 | $ | 950 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 906 | AUD | 1.308 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 951 | | 1.361 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 1.444 | $ | 1.010 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 927 | AUD | 1.339 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.011 | | 1.444 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 188 | | 269 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 928 | | 1.339 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | | | | | | $ 44 | $ (8) | $ 36 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die ausschüttende Investor CAD (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 | 07/2019 | CAD | 215 | $ | 163 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 153 | CAD | 207 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 163 | | 215 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 3 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 217 | $ | 165 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 157 | CAD | 211 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 164 | | 215 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 156 | | 210 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | | | | | | $ 17 | $ (2) | $ 15 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) ausschüttend, Administrative CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 367.018 | CHF | 368.125 | $ 10.546 | $ 0 | $ 10.546 | 0,05 |
| BPS | 07/2019 | CHF | 161 | $ | 162 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 599 | CHF | 589 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF | 377.133 | $ | 385.135 | 0 | (1.668) | (1.668) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 187.546 | CHF | 187.949 | 5.222 | 0 | 5.222 | 0,03 |
| | 08/2019 | | 386.015 | | 376.897 | 1.680 | 0 | 1.680 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | CHF | 777 | $ | 798 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 368.175 | CHF | 370.561 | 11.889 | 0 | 11.889 | 0,06 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 378.504 | $ | 387.409 | 0 | (800) | (800) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.300 | CHF | 1.268 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 387.729 | | 377.709 | 801 | 0 | 801 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CHF | 126 | $ | 127 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.761 | CHF | 6.724 | 135 | 0 | 135 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 175.080 | | 175.585 | 5.008 | 0 | 5.008 | 0,02 |
| SSB | 07/2019 | CHF | 341 | $ | 345 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 526 | CHF | 525 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | | | | | | $ 35.301 | $ (2.479) | $ 32.822 | 0,16 |

Zum 30. Juni 2019 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | $ | 29.380 | CZK | 680.000 | $ 1.055 | $ 0 | $ 1.055 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | | 29.152 | | 675.147 | 1.065 | 0 | 1.065 | 0,01 |
| SOG | 07/2019 | | 30.667 | | 710.063 | 1.113 | 0 | 1.113 | 0,00 |
| | | | | | | $ 3.233 | $ 0 | $ 3.233 | 0,02 |

Zum 30. Juni 2019 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 R EUR (Hedged) ausschüttend und Class T EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 2.112 | $ | 1.475 | $ 0 | $ (7) | $ (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 5.080 | | 3.862 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 904 | CHF | 906 | 26 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.477 | AUD | 2.112 | 7 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 3.865 | CAD | 5.080 | 25 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € | 355 | $ | 399 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 5.268 | | 6.681 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 142 | € | 126 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 6.691 | £ | 5.268 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | € | 25.432 | $ | 28.904 | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.462 | AUD | 2.112 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 30 | € | 27 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.471 | ¥ | 160.267 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 28.830 | € | 25.303 | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 505 | | 450 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 906 | $ | 928 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.769 | CAD | 5.080 | 119 | 0 | 119 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 930 | CHF | 906 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | | 70 | SEK | 669 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 147 | $ | 165 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.667 | £ | 5.268 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 157 | NZD | 239 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 28.183 | € | 25.204 | 520 | 0 | 520 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | ¥ | 160.267 | $ | 1.489 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.493 | ¥ | 160.267 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 868 | $ (124) | $ 744 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | $ | 329.287 | $ | 374.202 | $ 0 | $ (790) | $ (790) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 832.237 | € | 744.818 | 15.962 | 0 | 15.962 | 0,08 |
| | 08/2019 | | 375.155 | | 329.287 | 795 | 0 | 795 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | $ | 5.184 | $ | 5.850 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 15.051 | € | 13.270 | 64 | (3) | 61 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | | 325.131 | | 290.692 | 5.909 | 0 | 5.909 | 0,03 |
| CBK | 07/2019 | $ | 1.418.213 | $ | 1.611.819 | 0 | (3.244) | (3.244) | (0,02) |
| | 07/2019 | € | 1.550.959 | € | 1.388.047 | 29.772 | (22) | 29.750 | 0,15 |
| GLM | 08/2019 | | 1.582.529 | | 1.388.916 | 3.210 | 0 | 3.210 | 0,02 |
| RBC | 07/2019 | | 1.524.110 | | 1.365.467 | 30.885 | 0 | 30.885 | 0,16 |
| RYL | 07/2019 | | 2.765 | | 2.438 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 27.943 | | 24.707 | 193 | 0 | 193 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 8.588 | $ | 9.683 | 0 | (97) | (97) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € | 27.760 | € | 24.736 | 410 | 0 | 410 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 23.870 | $ | 26.996 | 0 | (187) | (187) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 344.211 | € | 308.209 | 6.777 | 0 | 6.777 | 0,03 |
| | | | | | | $ 93.988 | $ (4.396) | $ 89.592 | 0,45 |

Zum 30. Juni 2019 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 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 | 07/2019 | £ | 6.713 | $ | 8.501 | $ 0 | $ (43) | $ (43) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4.367 | £ | 3.450 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 1.150.600 | $ | 1.459.465 | 0 | (4.904) | (4.904) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 101.559 | £ | 80.035 | 302 | 0 | 302 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.425.721 | | 1.122.353 | 4.920 | 0 | 4.920 | 0,02 |
| CBK | 07/2019 | £ | 1.126.994 | $ | 1.431.955 | 0 | (2.371) | (2.371) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 1.392.849 | £ | 1.099.285 | 6.213 | (1) | 6.212 | 0,03 |
| | 08/2019 | | 1.434.150 | | 1.126.994 | 2.407 | 0 | 2.407 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | £ | 379 | $ | 481 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 15.413 | £ | 12.193 | 105 | 0 | 105 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 5.454 | | 4.304 | 25 | (1) | 24 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 694 | | 544 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 1.390.967 | | 1.098.973 | 7.696 | 0 | 7.696 | 0,04 |
| SSB | 07/2019 | £ | 4.943 | $ | 6.294 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.351.363 | £ | 1.069.499 | 9.789 | 0 | 9.789 | 0,05 |
| | | | | | | $ 31.484 | $ (7.322) | $ 24.162 | 0,12 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional HUF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 10.298 | HUF | 2.990.994 | $ 255 | $ 0 | $ 255 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 10.370 | | 3.014.586 | 266 | 0 | 266 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 10.324 | | 2.997.968 | 253 | 0 | 253 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 202 | | 58.602 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | | | | | | $ 779 | $ 0 | $ 779 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional ILS (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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | $ | 381 | ILS | 1.382 | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 23.145 | | 84.022 | 414 | 0 | 414 | 0,01 |
| JPM | 07/2019 | ILS | 198 | $ | 55 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | $ | 21.671 | ILS | 78.555 | 355 | 0 | 355 | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | | 22.553 | | 81.821 | 388 | 0 | 388 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | ILS | 338 | $ | 94 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.164 | $ (2) | $ 1.162 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | $ | 563 | NOK | 4.901 | $ 12 | $ 0 | $ 12 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 13.427 | | 117.704 | 378 | 0 | 378 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | NOK | 124.666 | $ | 14.653 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 14.668 | NOK | 124.666 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | NOK | 124.354 | $ | 14.617 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 14.632 | NOK | 124.354 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 13.852 | | 121.124 | 354 | 0 | 354 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 201 | | 1.726 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | | 69 | | 589 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 13.841 | | 121.124 | 365 | 0 | 365 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.173 | $ (62) | $ 1.111 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional PLN (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 72 | PLN | 270 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | PLN | 74 | $ | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | $ | 26 | PLN | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | | 549 | | 2.112 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 699 | | 2.685 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 536 | | 2.062 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 23 | | 88 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 55 | $ 0 | $ 55 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | CNH | 439 | $ | 64 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 64 | CNH | 441 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CNH | 439 | $ | 64 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 64 | CNH | 441 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 64 | | 444 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 62 | | 430 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | CNH | 439 | $ | 64 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 61 | CNH | 423 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 64 | | 441 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | CNH | 411 | $ | 60 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 62 | CNH | 430 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 60 | | 413 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional SEK (Hedged) thesaurierend und Administrative SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 124 | SEK | 1.162 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 415 | | 3.956 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 134.292 | | 1.279.099 | 3.569 | 0 | 3.569 | 0,02 |
| GLM | 07/2019 | | 3.001 | | 28.373 | 57 | 0 | 57 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SEK | 1.102 | $ | 119 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 232 | SEK | 2.183 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | | 138.151 | | 1.324.268 | 4.578 | 0 | 4.578 | 0,02 |
| JPM | 07/2019 | SEK | 1.324.694 | $ | 142.783 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 143.117 | SEK | 1.324.694 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | SEK | 58.966 | $ | 6.245 | 0 | (110) | (110) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 1.325.009 | | 142.881 | 72 | 0 | 72 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 138.396 | SEK | 1.324.268 | 4.333 | 0 | 4.333 | 0,02 |
| | 08/2019 | | 143.213 | | 1.325.009 | 0 | (67) | (67) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 132 | | 1.245 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | | | | | | $ 12.637 | $ (182) | $ 12.455 | 0,06 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend und E Class SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 181 | SGD | 250 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | SGD | 21.469 | $ | 15.854 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 13.091 | SGD | 18.063 | 259 | 0 | 259 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 15.908 | | 21.532 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 12.959 | | 17.798 | 196 | 0 | 196 | 0,00 |
| DUB | 07/2019 | | 12.952 | | 17.827 | 225 | 0 | 225 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | SGD | 21.512 | $ | 15.888 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 15.935 | SGD | 21.564 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SGD | 21.140 | $ | 15.579 | 0 | (46) | (46) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 739 | SGD | 1.014 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 17.260 | | 23.408 | 50 | 0 | 50 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 12.663 | | 17.448 | 233 | 0 | 233 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | | 872 | | 1.191 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 586 | | 793 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SGD | 19.085 | $ | 14.110 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 389 | SGD | 534 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 14.455 | | 19.543 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 4.600 | | 6.292 | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 2.039 | | 2.788 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.095 | $ (75) | $ 1.020 | 0,01 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 165.927** | **0,83** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | | | **$ 22.667.532** | **113,63** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | | | **$ (2.718.384)** | **(13,63)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | | | **$ 19.949.148** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(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.**

**(h) Mit dem Fonds verbunden.**

**(i) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(j) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 4,850 % | 25.05.2047 | 17.05.2017 - 09.04.2019 | $ 9.397 | $ 10.337 | 0,05 |
| AWAS Aviation Capital Ltd. | 4,870 | 25.05.2047 | 02.10.2014 | 29.091 | 29.450 | 0,15 |
| Farm Credit Bank of Texas | 10,000 | 25.05.2047 | 03.12.2010 | 4.350 | 4.420 | 0,02 |
| Oi S.A. (10,000 % bar) | 10,000 | 25.05.2047 | 08.05.2019 - 28.06.2019 | 5.562 | 5.499 | 0,03 |
| | | | | $ 48.400 | $ 49.706 | 0,25 |

**(k) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 824.060 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 18.441 und Barmittel in Höhe von USD 35.719 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 294.144 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 37.790 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(l) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 1.390 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | $ (1.418) | $ 1.390 | $ 1.390 | 0,01 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.418)** | **$ 1.390** | **$ 1.390** | **0,01** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 294.603 | $ 22.169.761 | $ 96.405 | $ 22.560.769 |
| Finanzderivate[3] | 38.911 | 67.546 | 306 | 106.763 |
| **Summen** | **$ 333.514** | **$ 22.237.307** | **$ 96.711** | **$ 22.667.532** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 265.567 | $ 19.145.620 | $ 107.849 | $ 19.519.036 |
| Finanzderivate[3] | 35.104 | (262) | 372 | 35.214 |
| Leerverkäufe | 0 | (28.009) | 0 | (28.009) |
| **Summen** | **$ 300.671** | **$ 19.117.349** | **$ 108.221** | **$ 19.526.241** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,520 % | 19.06.2019 | 03.07.2019 | $ (34.093) | $ (34.122) | (0,17) |
| BPS | 2,000 | 23.05.2019 | TBD[1] | $ (4.696) | (4.706) | (0,02) |
| BRC | (3,000) | 18.02.2019 | TBD[1] | € (4.800) | (5.407) | (0,03) |
| | (3,000) | 26.02.2019 | TBD[1] | € (3.329) | (3.752) | (0,02) |
| | 1,750 | 15.02.2019 | TBD[1] | $ (5.166) | (5.200) | (0,03) |
| | 2,300 | 24.06.2019 | TBD[1] | $ (4.872) | (4.874) | (0,02) |
| BSN | 2,560 | 26.04.2019 | 11.07.2019 | $ (49.945) | (50.179) | (0,25) |
| CFR | (3,000) | 13.02.2019 | TBD[1] | € (2.425) | (2.730) | (0,01) |
| | 0,000 | 01.05.2019 | TBD[1] | £ (4.300) | (5.473) | (0,03) |
| CIB | 2,590 | 15.04.2019 | 12.07.2019 | $ (51.538) | (51.823) | (0,26) |
| | 2,600 | 10.04.2019 | 10.07.2019 | $ (99.561) | (100.150) | (0,50) |
| | 2,600 | 18.04.2019 | 17.07.2019 | $ (176.142) | (177.083) | (0,89) |
| JPS | 2,600 | 25.04.2019 | 16.07.2019 | $ (5.506) | (5.533) | (0,03) |
| | 2,600 | 26.04.2019 | 16.07.2019 | $ (11.000) | (11.052) | (0,05) |
| | 2,600 | 14.05.2019 | 16.07.2019 | $ (13.050) | (13.095) | (0,07) |
| NXN | 2,540 | 05.04.2019 | 02.07.2019 | $ (84.940) | (85.461) | (0,43) |
| | 2,580 | 22.04.2019 | 18.07.2019 | $ (56.700) | (56.985) | (0,29) |
| RCY | 2,600 | 20.05.2019 | 22.07.2019 | $ (3.532) | (3.543) | (0,02) |
| | 2,600 | 13.06.2019 | 22.07.2019 | $ (32.410) | (32.452) | (0,16) |
| SBI | 2,500 | 12.06.2019 | TBD[1] | $ (16.666) | (16.688) | (0,08) |
| SCX | 2,600 | 28.06.2019 | 09.07.2019 | $ (104.250) | (104.273) | (0,52) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (774.581)** | **(3,88)** |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 34.392 | $ (32.830) | $ 1.562 |
| BPS | 2.847 | (1.190) | 1.657 |
| BRC | 7.267 | (6.630) | 637 |
| CBK | 47.267 | (41.770) | 5.497 |
| CKL | (155) | 0 | (155) |
| DUB | 711 | (970) | (259) |
| FBF | (11) | 30 | 19 |
| GLM | 53.003 | (49.800) | 3.203 |
| GST | 6.610 | (6.530) | 80 |
| HUS | (1.049) | 810 | (239) |
| IND | 4.580 | (4.820) | (240) |
| JLN | (13) | 0 | (13) |
| JPM | 12.111 | (11.870) | 241 |
| MSB | 17 | 0 | 17 |
| MYC | 2.174 | (5.385) | (3.211) |
| MYI | (40.564) | 36.950 | (3.614) |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| NGF | $ 23 | $ 0 | $ 23 |
| RBC | 11 | 0 | 11 |
| RYL | 92 | (260) | (168) |
| SCX | 17.771 | (11.960) | 5.811 |
| SOG | 2.233 | (1.830) | 403 |
| SSB | 15.787 | (9.900) | 5.887 |
| TOR | 532 | (410) | 122 |
| UAG | 291 | (400) | (109) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 85,79 | 80,12 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 27,29 | 33,04 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,01 | 0,03 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,20 | 0,21 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,49) | (0,21) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,83 | 0,21 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0,00 | (0,16) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (3,88) | (9,02) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,21 | 0,18 |
| Australien | 0,78 | 0,73 |
| Österreich | 0,05 | 0,00 |
| Belgien | 0,35 | 0,52 |
| Bermuda | 0,69 | 0,67 |
| Brasilien | 0,70 | 0,85 |
| Kanada | 1,69 | 1,65 |
| Cayman-Inseln | 3,81 | 3,25 |
| Chile | 0,17 | 0,23 |
| China | 1,12 | 1,29 |
| Kolumbien | 0,00 | 0,01 |
| Curacao | 0,09 | 0,10 |
| Dänemark | 0,20 | 0,19 |
| Finnland | 0,16 | 0,20 |
| Frankreich | 1,95 | 1,74 |
| Deutschland | 2,14 | 1,90 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,55 | 0,81 |
| Hongkong | 1,05 | 1,88 |
| Indien | 0,71 | 0,78 |
| Indonesien | 0,31 | 0,31 |
| Irak | 0,01 | 0,02 |
| Irland | 2,61 | 2,67 |
| Insel Man | 0,06 | 0,00 |
| Italien | 1,13 | 0,97 |
| Japan | 2,47 | 2,69 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,68 | 0,88 |
| Kuwait | 0,29 | 0,33 |
| Luxemburg | 3,43 | 2,66 |
| Mauritius | 0,01 | 0,01 |
| Mexiko | 0,75 | 0,81 |
| Niederlande | 3,44 | 4,54 |
| Neuseeland | 0,05 | 0,06 |
| Norwegen | 0,24 | 0,20 |
| Panama | 0,08 | 0,10 |
| Peru | 0,86 | 0,88 |
| Katar | 0,47 | 0,48 |
| Russland | 0,05 | 0,02 |
| Saudi-Arabien | 0,59 | 0,68 |
| Singapur | 0,35 | 0,33 |
| Slowenien | 0,03 | 0,04 |
| Südkorea | 0,12 | 0,14 |
| Spanien | 1,40 | 1,35 |
| Schweden | 0,23 | 0,28 |
| Schweiz | 2,57 | 2,62 |
| Thailand | 0,01 | 0,04 |
| Türkei | 0,03 | 0,03 |
| Ukraine | 0,02 | 0,02 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,30 | 0,19 |
| Großbritannien | 7,39 | 8,42 |
| Vereinigte Staaten | 66,52 | 64,08 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,14 | 0,17 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,01 | 0,19 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,02 | 0,00 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,20 | 0,21 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen - Schutzkauf | 0,01 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,04 | (0,06) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,01) | 0,06 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,04 | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,57) | (0,21) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | 0,00 | 0,01 |
| Zinsswapoption | 0,37 | 0,25 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | (0,01) |
| Zinsswapoption | (0,30) | (0,23) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | (0,05) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,15 | 0,07 |
| Zinsswaps | 0,00 | 0,06 |
| Devisenterminkontrakte | (0,22) | 0,01 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,84 | 0,10 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | 0,00 | (0,16) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (13,63) | (13,24) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen Global Investment Grade Credit ESG Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Australia & New Zealand Banking Group Ltd.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 03.06.2020 | AUD | 100 | $ | 71 | 0,10 |
| **Boral Finance Pty. Ltd.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.11.2022 | $ | 150 | | 150 | 0,20 |
| 3,750 % fällig am 01.05.2028 | | 200 | | 201 | 0,27 |
| **Optus Finance Pty. Ltd.** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.06.2029 | € | 300 | | 347 | 0,47 |
| **Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 30.04.2025 | $ | 150 | | 152 | 0,21 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.09.2026 | | 215 | | 219 | 0,30 |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | | 100 | | 100 | 0,13 |
| Summe Australien | | | | 1.240 | 1,68 |
| **BELGIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **KBC Group NV** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 27.06.2023 | € | 300 | | 352 | 0,48 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Flemish Community** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 11.04.2044 | | 300 | | 378 | 0,51 |
| Summe Belgien | | | | 730 | 0,99 |
| **BRASILIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Suzano Austria GmbH** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 16.03.2047 | $ | 200 | | 228 | 0,31 |
| **KANADA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2024 | | 30 | | 31 | 0,04 |
| **Encana Corp.** | | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.09.2030 | | 100 | | 133 | 0,18 |
| | | | | 164 | 0,22 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Canada Housing Trust** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.12.2028 | CAD | 1.000 | | 817 | 1,11 |
| Summe Kanada | | | | 981 | 1,33 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | | |
| 3,975 % fällig am 11.04.2029 | $ | 500 | | 523 | 0,71 |
| **CHILE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Corp. Nacional del Cobre de Chile** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.08.2027 | | 200 | | 208 | 0,28 |
| **Latam Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.08.2029 | | 244 | | 247 | 0,34 |
| | | | | 455 | 0,62 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Chile Government International Bond** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 25.01.2050 | | 300 | | 306 | 0,41 |
| Summe Chile | | | | 761 | 1,03 |
| **CHINA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | | |
| 2,957 % fällig am 08.11.2022 | | 600 | | 606 | 0,82 |
| **KOLUMBIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **SURA Asset Management S.A.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 11.04.2027 | $ | 200 | $ | 208 | 0,28 |
| **DÄNEMARK** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 28.09.2025 | | 200 | | 201 | 0,27 |
| **Orsted A/S** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 17.05.2027 | £ | 100 | | 131 | 0,18 |
| 2,500 % fällig am 16.05.2033 | | 200 | | 265 | 0,36 |
| Summe Dänemark | | | | 597 | 0,81 |
| **FRANKREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 19.12.2024 | | 100 | | 128 | 0,17 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 09.01.2025 | $ | 300 | | 305 | 0,41 |
| 3,375 % fällig am 23.01.2026 | £ | 200 | | 270 | 0,37 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 05.12.2023 | € | 200 | | 235 | 0,32 |
| 3,750 % fällig am 24.04.2023 | $ | 300 | | 312 | 0,42 |
| **Danone S.A.** | | | | | |
| 2,947 % fällig am 02.11.2026 | | 200 | | 200 | 0,27 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 13.10.2025 | | 250 | | 264 | 0,36 |
| **HSBC France S.A.** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 17.05.2024 | € | 100 | | 115 | 0,16 |
| | | | | 1.829 | 2,48 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **SNCF Reseau** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 500 | | 562 | 0,76 |
| Summe Frankreich | | | | 2.391 | 3,24 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Landesbank Baden-Wuerttemberg** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 31.05.2022 | $ | 400 | | 404 | 0,55 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 300 | | 364 | 0,49 |
| **INDIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Adani Green Energy UP Ltd.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.12.2024 | $ | 400 | | 409 | 0,56 |
| **Axis Bank Ltd.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.08.2022 | | 200 | | 199 | 0,27 |
| **Bharti Airtel International Netherlands BV** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 20.05.2021 | € | 200 | | 239 | 0,32 |
| **Bharti Airtel Ltd.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.06.2025 | $ | 200 | | 203 | 0,28 |
| Summe Indien | | | | 1.050 | 1,43 |
| **INDONESIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 20.07.2023 | | 300 | | 315 | 0,43 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | | |
| 2,150 % fällig am 18.07.2024 | € | 300 | | 364 | 0,49 |
| Summe Indonesien | | | | 679 | 0,92 |
| **IRLAND** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Aurium CLO DAC** | | | | | |
| 0,800 % fällig am 26.04.2029 | | 100 | | 114 | 0,16 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | | | |
| 0,850 % fällig am 15.04.2027 | € | 180 | $ | 205 | 0,28 |
| **Orwell Park CLO Designated Activity Co.** | | | | | |
| 0,780 % fällig am 18.07.2029 | | 100 | | 114 | 0,15 |
| | | | | 433 | 0,59 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | | |
| 4,450 % fällig am 03.04.2026 | $ | 350 | | 370 | 0,50 |
| **ESB Finance DAC** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 11.06.2030 | € | 100 | | 117 | 0,16 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | | |
| 3,373 % fällig am 15.11.2025 | $ | 100 | | 101 | 0,14 |
| 4,418 % fällig am 15.11.2035 | | 200 | | 198 | 0,27 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 31.07.2019 | £ | 100 | | 128 | 0,17 |
| | | | | 914 | 1,24 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Ireland Government International Bond** | | | | | |
| 1,350 % fällig am 18.03.2031 | € | 300 | | 381 | 0,51 |
| Summe Irland | | | | 1.728 | 2,34 |
| **ITALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | $ | 600 | | 632 | 0,86 |
| **JAPAN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 2,527 % fällig am 13.09.2023 | | 400 | | 399 | 0,54 |
| 3,446 % fällig am 26.07.2023 | | 300 | | 301 | 0,41 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 0,956 % fällig am 16.10.2024 | € | 100 | | 118 | 0,16 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 0,465 % fällig am 30.05.2024 | | 300 | | 344 | 0,46 |
| 0,934 % fällig am 11.10.2024 | | 300 | | 352 | 0,48 |
| 3,102 % fällig am 17.01.2023 | $ | 400 | | 407 | 0,55 |
| 3,452 % fällig am 19.07.2023 | | 100 | | 101 | 0,14 |
| Summe Japan | | | | 2.022 | 2,74 |
| **LUXEMBURG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** | | | | | |
| 0,875 % fällig am 26.07.2027 | € | 400 | | 491 | 0,67 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | | |
| 1,876 % fällig am 17.04.2025 | | 200 | | 247 | 0,33 |
| Summe Luxemburg | | | | 738 | 1,00 |
| **MEXICO** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 27.09.2024 (c)(d) | $ | 200 | | 200 | 0,27 |
| **Trust F** | | | | | |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 200 | | 206 | 0,28 |
| Summe Mexiko | | | | 406 | 0,55 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Jubilee CLO BV** | | | | | |
| 0,530 % fällig am 12.07.2028 | € | 200 | | 228 | 0,31 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 09.06.2020 | | 95 | | 109 | 0,15 |
| **BNG Bank NV** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 26.11.2025 | | 500 | | 595 | 0,81 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 (d) | | 300 | | 359 | 0,49 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 21.06.2028 | $ | 200 | | 218 | 0,29 |
| **Enel Finance International NV** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.09.2023 | | 200 | | 210 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 4,625 % fällig am 14.09.2025 | $ | 600 | $ 645 | 0,87 |
| **Euronext NV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 12.06.2029 | € | 300 | 351 | 0,48 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 3,000 % fällig am 18.02.2026 | £ | 100 | 133 | 0,18 |
| 4,100 % fällig am 02.10.2023 | $ | 300 | 317 | 0,43 |
| 4,625 % fällig am 06.01.2026 | | 200 | 218 | 0,30 |
| **Koninklijke KPN NV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 18.11.2026 | £ | 200 | 285 | 0,39 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 1,375 % fällig am 07.03.2024 | € | 100 | 117 | 0,16 |
| **Nederlandse Waterschapsbank NV** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.06.2039 | | 200 | 262 | 0,35 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (c) | | 190 | 265 | 0,36 |
| | | | 4.084 | 5,54 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Domi BV** | | | | |
| 0,553 % fällig am 15.06.2051 | | 150 | 171 | 0,23 |
| Summe Niederlande | | | 4.483 | 6,08 |
| **PANAMA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco General S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 07.08.2027 | $ | 300 | 305 | 0,41 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Panama Government International Bond** | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.03.2025 | | 300 | 317 | 0,43 |
| Summe Panama | | | 622 | 0,84 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | PEN | 400 | 125 | 0,17 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | $ | 200 | 200 | 0,27 |
| 4,000 % fällig am 25.01.2024 | | 250 | 259 | 0,35 |
| **Clifford Capital Pte. Ltd.** | | | | |
| 3,423 % fällig am 15.11.2021 | | 200 | 206 | 0,28 |
| Summe Singapur | | | 665 | 0,90 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Shinhan Bank Co. Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 23.04.2029 (d) | | 400 | 415 | 0,56 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 21.06.2026 | € | 100 | 116 | 0,16 |
| 1,375 % fällig am 14.05.2025 | | 300 | 357 | 0,48 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (c)(d) | | 200 | 240 | 0,33 |
| 8,875 % fällig am 14.04.2021 (c)(d) | | 200 | 254 | 0,34 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 2,706 % fällig am 27.06.2024 | $ | 200 | 200 | 0,27 |
| 3,306 % fällig am 27.06.2029 | | 200 | 202 | 0,27 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (c)(d) | € | 100 | 120 | 0,16 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 24.10.2023 | | 100 | 119 | 0,16 |
| 2,375 % fällig am 01.02.2024 | | 100 | 122 | 0,17 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | | |
| 5,520 % fällig am 01.03.2049 | $ | 200 | 232 | 0,32 |
| | | | 1.962 | 2,66 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Madrid** | | | | |
| 1,571 % fällig am 30.04.2029 | € | 100 | 125 | 0,17 |
| Summe Spanien | | | 2.087 | 2,83 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (d) | $ | 500 | $ 552 | 0,75 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,125 % fällig am 12.09.2025 | £ | 100 | 126 | 0,17 |
| 4,282 % fällig am 09.01.2028 | $ | 250 | 264 | 0,36 |
| **UBS AG** | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (d) | | 600 | 673 | 0,91 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 2,859 % fällig am 15.08.2023 | | 400 | 404 | 0,55 |
| Summe Schweiz | | | 2.019 | 2,74 |
| **THAILAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Kasikornbank PCL** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.04.2022 | | 300 | 297 | 0,40 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Anglian Water Services Financing PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.10.2029 | £ | 100 | 137 | 0,18 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 0,625 % fällig am 14.11.2023 | € | 200 | 226 | 0,31 |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | £ | 300 | 390 | 0,53 |
| 3,905 % fällig am 16.05.2024 | $ | 300 | 296 | 0,40 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (c)(d) | | 300 | 315 | 0,43 |
| **British Land Co. PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.09.2029 | £ | 100 | 127 | 0,17 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 21.11.2024 | € | 200 | 235 | 0,32 |
| 9,625 % fällig am 15.12.2030 | $ | 40 | 60 | 0,08 |
| **Experian Finance PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.02.2029 | | 200 | 217 | 0,29 |
| **Grainger PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2028 | £ | 100 | 132 | 0,18 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 22.07.2028 | | 100 | 133 | 0,18 |
| 3,803 % fällig am 11.03.2025 | $ | 300 | 313 | 0,42 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 1.000 | 1.045 | 1,42 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 24.08.2026 | £ | 100 | 126 | 0,17 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,574 % fällig am 07.11.2028 | $ | 200 | 200 | 0,27 |
| 4,550 % fällig am 16.08.2028 | | 300 | 323 | 0,44 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.12.2023 | £ | 100 | 130 | 0,18 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 03.07.2039 (a) | | 100 | 125 | 0,17 |
| 5,375 % fällig am 28.06.2022 | | 50 | 72 | 0,10 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,622 % fällig am 26.04.2023 | $ | 200 | 204 | 0,28 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.06.2022 | | 200 | 200 | 0,27 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 400 | 414 | 0,56 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | | 400 | 404 | 0,55 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (c)(d) | £ | 200 | 271 | 0,37 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 18.06.2024 | $ | 300 | 302 | 0,41 |
| 4,000 % fällig am 13.03.2024 | | 150 | 158 | 0,21 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.05.2029 | £ | 100 | 132 | 0,18 |
| Summe Großbritannien | | | 6.687 | 9,07 |
| **USA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 17.05.2024 | € | 300 | 357 | 0,48 |
| 4,250 % fällig am 14.11.2028 | $ | 100 | 107 | 0,14 |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.09.2021 | | 300 | 300 | 0,41 |
| 3,400 % fällig am 15.09.2026 | | 250 | 254 | 0,34 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 30.04.2025 | $ | 400 | $ 412 | 0,56 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2024 | | 150 | 159 | 0,22 |
| **Allegion U.S. Holding Co., Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.10.2027 | | 230 | 227 | 0,31 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 21.05.2024 | | 200 | 205 | 0,28 |
| **American Campus Communities Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.04.2023 | | 500 | 517 | 0,70 |
| **American Express Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.05.2022 | | 200 | 203 | 0,27 |
| 3,000 % fällig am 30.10.2024 | | 120 | 123 | 0,17 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 22.05.2026 | € | 200 | 243 | 0,33 |
| 3,300 % fällig am 15.02.2021 | $ | 40 | 41 | 0,06 |
| **American Water Capital Corp.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 01.06.2029 | | 200 | 208 | 0,28 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 19.08.2023 | | 300 | 299 | 0,41 |
| 4,663 % fällig am 15.06.2051 | | 200 | 219 | 0,30 |
| **Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.** | | | | |
| 5,800 % fällig am 23.01.2059 | | 100 | 126 | 0,17 |
| **Apple, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 20.06.2027 | | 355 | 364 | 0,49 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 09.03.2048 | | 80 | 82 | 0,11 |
| 4,550 % fällig am 09.03.2049 | | 100 | 102 | 0,14 |
| 5,100 % fällig am 25.11.2048 | CAD | 300 | 251 | 0,34 |
| 5,700 % fällig am 01.03.2057 | $ | 150 | 177 | 0,24 |
| **Atlantic City Electric Co.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.10.2028 | | 200 | 220 | 0,30 |
| **Autodesk, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.06.2027 | | 30 | 30 | 0,04 |
| **Avangrid, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 01.06.2029 | | 300 | 314 | 0,43 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.11.2027 | | 100 | 100 | 0,14 |
| 7,125 % fällig am 15.10.2020 | | 130 | 138 | 0,19 |
| **AXA Equitable Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 20.04.2028 | | 200 | 211 | 0,29 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 3,559 % fällig am 23.04.2027 | | 100 | 104 | 0,14 |
| **Bank of America N.A.** | | | | |
| 3,335 % fällig am 25.01.2023 | | 500 | 513 | 0,70 |
| **Bank of New York Mellon Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.10.2028 | | 400 | 402 | 0,54 |
| 3,450 % fällig am 11.08.2023 | | 200 | 209 | 0,28 |
| **Blackstone Holdings Finance Co. LLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 10.04.2029 | € | 100 | 118 | 0,16 |
| **Boston Properties LP** | | | | |
| 3,400 % fällig am 21.06.2029 | $ | 200 | 205 | 0,28 |
| 3,650 % fällig am 01.02.2026 | | 320 | 333 | 0,45 |
| **Brambles USA, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 23.10.2025 | | 50 | 53 | 0,07 |
| **Brandywine Operating Partnership LP** | | | | |
| 4,550 % fällig am 01.10.2029 | | 100 | 106 | 0,14 |
| **Bristol-Myers Squibb Co.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 26.10.2049 | | 100 | 111 | 0,15 |
| **Brooklyn Union Gas Co.** | | | | |
| 3,407 % fällig am 10.03.2026 | | 222 | 229 | 0,31 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.03.2025 | | 200 | 208 | 0,28 |
| 4,150 % fällig am 15.03.2028 | | 150 | 157 | 0,21 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 6,500 % fällig am 17.06.2022 | | 20 | 22 | 0,03 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 (a) | | 400 | 410 | 0,56 |
| **Chubb INA Holdings, Inc.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 15.06.2027 | € | 200 | 231 | 0,31 |
| 1,400 % fällig am 15.06.2031 | | 100 | 116 | 0,16 |
| 3,150 % fällig am 15.03.2025 | $ | 150 | 156 | 0,21 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 23.01.2024 | | 250 | 263 | 0,36 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 29.01.2022 | € | 400 | 462 | 0,63 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Investment Grade Credit ESG Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,700 % fällig am 27.10.2022 | $ | 200 | $ 202 | 0,27 |
| **Consolidated Edison Co. of New York, Inc.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.12.2056 | | 100 | 108 | 0,15 |
| **CRH America, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 18.05.2025 | | 400 | 419 | 0,57 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2021 | | 50 | 52 | 0,07 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 15.02.2049 | | 100 | 115 | 0,16 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 25.03.2028 | | 100 | 106 | 0,14 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 5,300 % fällig am 01.10.2029 | | 200 | 211 | 0,29 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | € | 100 | 124 | 0,17 |
| **Digital Stout Holding LLC** | | | | |
| 3,300 % fällig am 19.07.2029 | £ | 100 | 133 | 0,18 |
| 3,750 % fällig am 17.10.2030 | | 100 | 136 | 0,18 |
| **Discover Financial Services** | | | | |
| 4,500 % fällig am 30.01.2026 | $ | 200 | 215 | 0,29 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.05.2029 | | 300 | 313 | 0,42 |
| **DTE Electric Co.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.03.2049 | | 200 | 218 | 0,30 |
| **Duke Energy Carolinas LLC** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.11.2028 | | 300 | 327 | 0,44 |
| **Duquesne Light Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,400 % fällig am 15.09.2020 | | 50 | 52 | 0,07 |
| **E*TRADE Financial Corp.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 24.08.2027 | | 200 | 202 | 0,27 |
| **Edwards Lifesciences Corp.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.06.2028 | | 155 | 168 | 0,23 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.11.2023 | | 130 | 130 | 0,18 |
| **ERP Operating LP** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2029 | | 200 | 203 | 0,28 |
| 4,150 % fällig am 01.12.2028 | | 100 | 111 | 0,15 |
| **Exelon Corp.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.06.2025 | | 50 | 53 | 0,07 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2031 (a) | £ | 100 | 129 | 0,17 |
| 4,400 % fällig am 01.07.2049 | $ | 100 | 106 | 0,14 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,380 % fällig am 01.12.2024 | € | 200 | 213 | 0,29 |
| 1,514 % fällig am 17.02.2023 | | 200 | 229 | 0,31 |
| 3,336 % fällig am 18.03.2021 | $ | 200 | 201 | 0,27 |
| **Fortune Brands Home & Security, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.09.2023 | | 230 | 242 | 0,33 |
| **GATX Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.03.2028 | | 150 | 151 | 0,20 |
| 4,500 % fällig am 30.03.2045 | | 100 | 100 | 0,14 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 1,250 % fällig am 26.05.2023 | € | 300 | 353 | 0,48 |
| 2,700 % fällig am 09.10.2022 | $ | 150 | 150 | 0,20 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,640 % fällig am 30.06.2022 | | 100 | 100 | 0,14 |
| **Georgetown University** | | | | |
| 5,215 % fällig am 01.10.2118 | | 100 | 125 | 0,17 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 250 | 262 | 0,35 |
| 4,223 % fällig am 01.05.2029 | | 500 | 537 | 0,73 |
| **Goodman U.S. Finance Three LLC** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | | 130 | 132 | 0,18 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.06.2049 | | 300 | 313 | 0,42 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2022 | | 100 | 109 | 0,15 |
| **Humana, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.03.2027 | | 95 | 99 | 0,13 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 26.09.2048 | | 140 | 156 | 0,21 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.08.2022 | | 150 | 163 | 0,22 |
| **Interstate Power & Light Co.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.04.2029 | | 200 | 208 | 0,28 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.01.2024 | | 200 | 206 | 0,28 |
| 3,875 % fällig am 11.06.2025 | | 300 | 320 | 0,43 |
| **Jeld-Wen, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.12.2027 | $ | 80 | $ 78 | 0,11 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 3,960 % fällig am 29.01.2027 | | 500 | 535 | 0,72 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.12.2024 | | 300 | 309 | 0,42 |
| 4,750 % fällig am 15.12.2028 | | 300 | 334 | 0,45 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 6,550 % fällig am 15.09.2040 | | 100 | 124 | 0,17 |
| 6,950 % fällig am 15.01.2038 | | 100 | 128 | 0,17 |
| 7,300 % fällig am 15.08.2033 | | 100 | 132 | 0,18 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 30.01.2029 | | 150 | 162 | 0,22 |
| 4,875 % fällig am 15.02.2025 | | 100 | 103 | 0,14 |
| **Liberty Property LP** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.02.2029 | | 100 | 108 | 0,15 |
| **Marriott International, Inc.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 01.12.2028 | | 300 | 330 | 0,45 |
| **Marsh & McLennan Cos., Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 03.06.2024 | | 140 | 146 | 0,20 |
| **Masco Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.11.2027 | | 155 | 152 | 0,21 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2047 | | 100 | 95 | 0,13 |
| **Mead Johnson Nutrition Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.11.2025 | | 20 | 22 | 0,03 |
| **Microsoft Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 06.02.2057 | | 355 | 435 | 0,59 |
| **MidAmerican Energy Co.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 01.05.2027 | | 30 | 31 | 0,04 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,392 % fällig am 08.11.2022 | € | 200 | 229 | 0,31 |
| **MUFG Americas Holdings Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 18.06.2022 | $ | 40 | 41 | 0,06 |
| **New York Life Insurance Co.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.05.2069 | | 100 | 110 | 0,15 |
| **Newfield Exploration Co.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.01.2026 | | 200 | 219 | 0,30 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 01.12.2077 | | 300 | 282 | 0,38 |
| 5,650 % fällig am 01.05.2079 | | 300 | 310 | 0,42 |
| **Niagara Mohawk Power Corp.** | | | | |
| 2,721 % fällig am 28.11.2022 | | 100 | 101 | 0,14 |
| **NSTAR Electric Co.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2029 | | 300 | 312 | 0,42 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | | 200 | 217 | 0,29 |
| **Owens Corning** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.08.2026 | | 300 | 292 | 0,40 |
| 4,300 % fällig am 15.07.2047 | | 100 | 85 | 0,12 |
| **PNC Financial Services Group, Inc.** | | | | |
| 2,854 % fällig am 09.11.2022 | | 150 | 153 | 0,21 |
| 3,450 % fällig am 23.04.2029 | | 400 | 421 | 0,57 |
| **Potomac Electric Power Co.** | | | | |
| 7,900 % fällig am 15.12.2038 | | 30 | 46 | 0,06 |
| **Prologis LP** | | | | |
| 2,250 % fällig am 30.06.2029 | £ | 300 | 386 | 0,52 |
| **Public Service Electric & Gas Co.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.09.2026 | $ | 225 | 219 | 0,30 |
| **Quicken Loans, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | | 140 | 140 | 0,19 |
| **Regency Centers LP** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.02.2027 | | 100 | 103 | 0,14 |
| **Reliance Standard Life Global Funding** | | | | |
| 3,850 % fällig am 19.09.2023 | | 40 | 42 | 0,06 |
| **RELX Capital, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.10.2022 | | 50 | 51 | 0,07 |
| **Ryder System, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.06.2022 | | 600 | 607 | 0,82 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | | 200 | 219 | 0,30 |
| 5,875 % fällig am 30.06.2026 | | 300 | 343 | 0,46 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.06.2047 | | 100 | 96 | 0,13 |
| 3,950 % fällig am 15.11.2041 | | 100 | 97 | 0,13 |
| 4,300 % fällig am 01.04.2042 | | 100 | 102 | 0,14 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.12.2041 | $ | 100 | $ 94 | 0,13 |
| 3,900 % fällig am 15.03.2043 | | 100 | 97 | 0,13 |
| 4,650 % fällig am 01.10.2043 | | 100 | 107 | 0,14 |
| 6,650 % fällig am 01.04.2029 | | 100 | 115 | 0,16 |
| **Southern California Gas Co.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.09.2024 | | 100 | 103 | 0,14 |
| 3,200 % fällig am 15.06.2025 | | 100 | 102 | 0,14 |
| 3,950 % fällig am 15.02.2050 | | 100 | 105 | 0,14 |
| 4,125 % fällig am 01.06.2048 | | 50 | 54 | 0,07 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.06.2026 | | 100 | 100 | 0,14 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2028 | | 150 | 158 | 0,21 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 31.01.2023 | | 400 | 401 | 0,54 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 08.02.2029 | | 400 | 429 | 0,58 |
| **Waste Management, Inc.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.06.2026 | | 200 | 208 | 0,28 |
| **WEA Finance LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 17.09.2024 | | 300 | 313 | 0,42 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2029 | | 300 | 319 | 0,43 |
| 6,875 % fällig am 15.12.2033 | | 70 | 94 | 0,13 |
| **WRKCo, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.03.2025 | | 200 | 208 | 0,28 |
| 4,900 % fällig am 15.03.2029 | | 50 | 55 | 0,07 |
| **Zoetis, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 13.11.2025 | | 350 | 384 | 0,52 |
| | | | 30.492 | 41,33 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **University of California Revenue Bonds, Series 2019** | | | | |
| 3,349 % fällig am 01.07.2029 | | 200 | 212 | 0,29 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae UMBS** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2048 | | 977 | 1.029 | 1,40 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 3.800 | 3.885 | 5,27 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | | 3.800 | 3.926 | 5,32 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2048 | | 371 | 393 | 0,53 |
| | | | 9.233 | 12,52 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.05.2049 | | 218 | 234 | 0,32 |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 240 | 263 | 0,35 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)** | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.04.2023 | | 617 | 625 | 0,85 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 (e) | | 814 | 849 | 1,15 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | | 1.012 | 1.065 | 1,44 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 | | 183 | 189 | 0,26 |
| | | | 3.225 | 4,37 |
| Summe USA | | | 43.162 | 58,51 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (f)** | | | | |
| | | | 5.283 | 7,16 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 5.283 | 7,16 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 82.133** | **111,34** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 1 | $ (1) | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 19 | 34 | 0,05 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1 | 1 | 0,00 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09/2019 | 5 | (6) | (0,01) |
| | | | | $ 28 | 0,04 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 126,500 | 26.07.2019 | 11 | $ (3) | $ (1) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 11 | (2) | (3) | (0,01) |
| | | | | $ (5) | $ (4) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 24** | **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 – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Koninklijke KPN N.V. | (1,000) % | 20.12.2023 | € 200 | $ (4) | (0,01) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 % | 20.12.2023 | $ 100 | $ 0 | 0,00 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,880 % | 02.07.2019 | $ 200 | $ (1) | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,940 | 02.07.2019 | 300 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 27.06.2024 | 200 | (2) | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 28.06.2024 | 300 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,050 | 19.06.2024 | 200 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,060 | 21.06.2024 | 200 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,080 | 20.06.2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,080 | 26.06.2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,090 | 24.06.2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,100 | 18.06.2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,110 | 25.06.2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,160 | 12.06.2024 | 200 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,190 | 11.06.2024 | 200 | (4) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,200 | 05.06.2024 | 200 | (4) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,210 | 04.06.2024 | 200 | (4) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,210 | 12.06.2024 | 200 | (4) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,220 | 30.05.2024 | 200 | (4) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,240 | 29.05.2024 | 200 | (4) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 30.05.2024 | 200 | (4) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,270 | 06.06.2024 | 200 | (4) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 15.05.2024 | 200 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 28.05.2024 | 200 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 05.06.2024 | 200 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 17.05.2024 | 200 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 22.05.2024 | 200 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,310 | 24.05.2024 | 200 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,320 | 21.05.2024 | 200 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,330 | 20.05.2024 | 200 | (5) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,430 | 26.03.2024 | 200 | (7) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,510 | 08.04.2024 | 200 | (7) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,510 | 09.04.2024 | 200 | (7) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 1.350 | (107) | (0,14) |
| | | | | | $ (230) | (0,31) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (234)** | **(0,32)** |

(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.

**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 | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,790 % | 11.07.2019 | 200 | $ 0 | $ (1) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,070 | 11.07.2019 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYC | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,880 | 01.07.2019 | 300 | (1) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,160 | 01.07.2019 | 300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (2) | $ (3) | 0,00 |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag(2) | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 400 | $ (13) | $ 4 | $ (9) | (0,01) |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 400 | (17) | 5 | (12) | (0,02) |
| GST | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 125 | (6) | 2 | (4) | (0,01) |
| | | | | | $ (36) | $ 11 | $ (25) | (0,04) |

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

(2) 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 | 08/2019 | € 8.937 | $ 10.118 | $ 0 | $ (97) | $ (97) | (0,13) |
| BPS | 08/2019 | £ 2.406 | 3.132 | 64 | 0 | 64 | 0,09 |
| BRC | 08/2019 | € 389 | 439 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 08/2019 | £ 99 | 124 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| CBK | 08/2019 | CAD 1.389 | 1.037 | 0 | (27) | (27) | (0,04) |
| | 08/2019 | € 1.289 | 1.454 | 0 | (19) | (19) | (0,03) |
| | 08/2019 | £ 67 | 85 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 105 | € 92 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | PEN 224 | $ 67 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | RUB 14.403 | 217 | 0 | (11) | (11) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ 221 | RUB 14.575 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | £ 18 | $ 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | € 128 | 144 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | PEN 167 | 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 346 | € 306 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | £ 1 | $ 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD 103 | 72 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 08/2019 | £ 396 | 512 | 7 | 0 | 7 | 0,01 |
| | | | | $ 82 | $ (166) | $ (84) | (0,11) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | $ 10.757 | $ 10.790 | $ 309 | $ 0 | $ 309 | 0,42 |
| BPS | 07/2019 | 19 | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF 11.329 | 11.570 | 0 | (50) | (50) | (0,07) |
| | 07/2019 | $ 22.616 | 22.364 | 355 | 0 | 355 | 0,48 |
| GSC | 07/2019 | 10.757 | 10.827 | 348 | 0 | 348 | 0,47 |
| HUS | 07/2019 | CHF 11.358 | 11.625 | 0 | (24) | (24) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ 11.659 | 11.358 | 24 | 0 | 24 | 0,03 |
| MYI | 07/2019 | 1.439 | 1.428 | 25 | 0 | 25 | 0,04 |
| SSB | 07/2019 | CHF 855 | 871 | 0 | (6) | (6) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 44 | 43 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 1.062 | $ (80) | $ 982 | 1,33 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 191 | $ 217 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 218 | 191 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € 181 | 206 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 206 | 181 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | 207 | 185 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | € 191 | 217 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 218 | 191 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GSC | 07/2019 | 201 | 180 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | 207 | 185 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| SCX | 07/2019 | 4 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 11 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 12 | $ 0 | $ 12 | 0,02 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | $ 6.036 | £ 4.771 | $ 36 | $ 0 | $ 36 | 0,05 |
| BPS | 07/2019 | £ 5.116 | $ 6.489 | 0 | (22) | (22) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ 14 | £ 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | 6.470 | 5.093 | 22 | 0 | 22 | 0,03 |
| CBK | 07/2019 | £ 5.082 | $ 6.457 | 0 | (11) | (11) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 6.194 | £ 4.889 | 28 | 0 | 28 | 0,04 |
| | 08/2019 | 6.467 | 5.082 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | 169 | 134 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 18 | 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 287 | 227 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 6.211 | 4.915 | 45 | 0 | 45 | 0,06 |
| | | | | $ 145 | $ (33) | $ 112 | 0,15 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 994** | **1,35** |
| **Summe Anlagen** | **$ 82.917** | **112,40** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (9.148)** | **(12,40)** |
| **Nettovermögen** | **$ 73.769** | **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) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

**(d) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(e) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 212 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 337 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**(f) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,440 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 4.300 | U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2047 | $ (4.394) | $ 4.300 | $ 4.300 | 5,83 |
| SSB | 1,350 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 983 | U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021 | (1.007) | 983 | 983 | 1,33 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (5.401)** | **$ 5.283** | **$ 5.283** | **7,16** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 82.133 | $ 0 | $ 82.133 |
| Finanzderivate[3] | 24 | 760 | 0 | 784 |
| **Summen** | **$ 24** | **$ 82.893** | **$ 0** | **$ 82.917** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 51.486 | $ 0 | $ 51.486 |
| Finanzderivate[3] | (52) | 142 | 0 | 90 |
| **Summen** | **$ (52)** | **$ 51.628** | **$ 0** | **$ 51.576** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,570 % | 08.05.2019 | 08.08.2019 | $ (206) | $ (207) | (0,28) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (207)** | **(0,28)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 248 | $ (260) | $ (12) |
| BPS | 64 | 0 | 64 |
| BRC | (4) | 0 | (4) |
| CBK | 265 | (320) | (55) |
| GLM | (3) | (270) | (273) |
| GSC | 352 | 0 | 352 |
| GST | (4) | 0 | (4) |
| MYC | (2) | 0 | (2) |
| MYI | 31 | 0 | 31 |
| SCX | 7 | 0 | 7 |
| SSB | 40 | 0 | 40 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 84,89 | 74,94 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 16,74 | 28,99 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 9,71 | 16,56 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,03 | (0,12) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,32) | (0,02) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,35 | 0,35 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,28) | (1,40) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 1,68 | 0,62 |
| Belgien | 0,99 | 0,80 |
| Bermuda | 0,00 | 0,36 |
| Brasilien | 0,31 | 0,48 |
| Kanada | 1,33 | 2,66 |
| Cayman-Inseln | 0,71 | 0,00 |
| Chile | 1,03 | 1,02 |
| China | 0,82 | 0,00 |
| Kolumbien | 0,28 | 0,44 |
| Dänemark | 0,81 | 0,00 |
| Frankreich | 3,24 | 3,07 |
| Deutschland | 0,55 | 0,00 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,49 | 0,00 |
| Indien | 1,43 | 0,43 |
| Indonesien | 0,92 | 0,70 |
| Irland | 2,34 | 2,37 |
| Italien | 0,86 | 1,34 |
| Japan | 2,74 | 3,60 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,00 | 0,52 |
| Luxemburg | 1,00 | 1,64 |
| Mexiko | 0,55 | 0,00 |
| Niederlande | 6,08 | 6,40 |
| Panama | 0,84 | 0,00 |
| Peru | 0,17 | 0,00 |
| Singapur | 0,90 | 0,92 |
| Südkorea | 0,56 | 0,00 |
| Spanien | 2,83 | 1,05 |
| Schweden | 0,00 | 0,71 |
| Schweiz | 2,74 | 1,93 |
| Thailand | 0,40 | 0,00 |
| Großbritannien | 9,07 | 7,19 |
| Vereinigte Staaten | 58,51 | 65,68 |
| Kurzfristige Instrumente | 7,16 | 16,56 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,04 | (0,12) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | 0,00 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | (0,01) | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,31) | (0,01) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Zinsswapoption | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,04) | (0,03) |
| Devisenterminkontrakte | (0,11) | 0,03 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,50 | 0,36 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (12,40) | (20,70) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Libor Plus Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Beacon Roofing Supply, Inc.** | | | | |
| 4,663 % fällig am 02.01.2025 | $ | 297 | $ 294 | 0,02 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | |
| 5,152 % fällig am 22.12.2024 | | 296 | 290 | 0,02 |
| **Core & Main LP** | | | | |
| 5,520 % fällig am 01.08.2024 | | 49 | 49 | 0,00 |
| **Crown Americas LLC** | | | | |
| 4,401 % fällig am 03.04.2025 | | 107 | 108 | 0,01 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | |
| 4,894 % fällig am 25.01.2026 | | 297 | 294 | 0,02 |
| **Financial & Risk U.S. Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,773 % - 4,000 % fällig am 01.10.2025 | € | 995 | 1.133 | 0,07 |
| **NCI Building Systems, Inc.** | | | | |
| 6,354 % fällig am 12.04.2025 | $ | 1.390 | 1.355 | 0,09 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,904 % - 9,000 % fällig am 17.11.2025 | | 1.592 | 1.587 | 0,10 |
| **UPC Financing Partnership** | | | | |
| 4,894 % fällig am 15.01.2026 | | 1.500 | 1.500 | 0,09 |
| | | | 6.610 | 0,42 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Aegon Bank NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2024 | € | 900 | 1.033 | 0,07 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 3,300 % fällig am 23.01.2023 | $ | 500 | 505 | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 03.07.2023 | | 1.500 | 1.561 | 0,10 |
| 4,625 % fällig am 01.07.2022 | | 600 | 627 | 0,04 |
| **AGFC Capital Trust** | | | | |
| 4,347 % fällig am 15.01.2067 | | 500 | 300 | 0,02 |
| **Air Lease Corp.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.03.2021 | | 400 | 400 | 0,03 |
| 3,875 % fällig am 01.04.2021 | | 1.100 | 1.124 | 0,07 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 400 | 401 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 15.04.2021 | | 200 | 204 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 15.09.2020 | | 200 | 211 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2020 | | 200 | 208 | 0,01 |
| **Altareit S.C.A.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 02.07.2025 | € | 500 | 595 | 0,04 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2023 | $ | 400 | 404 | 0,03 |
| **Annington Funding PLC** | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.07.2024 | € | 300 | 351 | 0,02 |
| 2,646 % fällig am 12.07.2025 | £ | 300 | 386 | 0,02 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 5.700 | 6.171 | 0,39 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 17.10.2022 | € | 2.500 | 3.053 | 0,19 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 20.01.2022 | $ | 100 | 101 | 0,01 |
| 3,253 % fällig am 30.07.2021 | | 1.000 | 997 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 01.05.2023 | | 1.000 | 1.034 | 0,07 |
| 6,750 % fällig am 06.04.2021 | | 2.000 | 2.137 | 0,14 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (f)(h) | € | 2.200 | 2.597 | 0,17 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (f)(h) | | 1.000 | 1.199 | 0,08 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (f)(h) | | 400 | 469 | 0,03 |
| 8,875 % fällig am 14.04.2021 (f)(h) | | 600 | 763 | 0,05 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (f)(h) | | 1.400 | 1.680 | 0,11 |
| **Banistmo S.A.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 19.09.2022 | $ | 1.800 | 1.811 | 0,12 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 3,269 % fällig am 05.03.2024 | | 1.300 | 1.302 | 0,08 |
| 3,300 % fällig am 11.01.2023 | | 50 | 52 | 0,00 |
| 3,419 % fällig am 20.12.2028 | | 23 | 24 | 0,00 |
| 3,499 % fällig am 17.05.2022 | | 500 | 510 | 0,03 |
| 3,550 % fällig am 05.03.2024 | | 1.600 | 1.660 | 0,11 |
| 3,581 % fällig am 24.04.2023 | | 100 | 101 | 0,01 |
| 3,864 % fällig am 23.07.2024 | | 1.800 | 1.892 | 0,12 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2024 | | 28 | 30 | 0,00 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (f)(h) | € | 2.300 | $ 2.770 | 0,18 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 20.07.2023 | $ | 1.000 | 1.049 | 0,07 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | | 800 | 874 | 0,06 |
| 10,179 % fällig am 12.06.2021 | | 1.860 | 2.106 | 0,13 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 12.01.2026 | | 1.700 | 1.763 | 0,11 |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | | 800 | 854 | 0,05 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | £ | 500 | 643 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (f)(h) | | 1.800 | 2.397 | 0,15 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (f)(h) | € | 3.100 | 3.826 | 0,24 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (f)(h) | $ | 1.700 | 1.784 | 0,11 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.02.2023 | € | 2.500 | 2.954 | 0,19 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.02.2024 | | 2.500 | 2.989 | 0,19 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 09.01.2025 | $ | 3.100 | 3.156 | 0,20 |
| 5,198 % fällig am 10.01.2030 | | 2.100 | 2.407 | 0,15 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 800 | 799 | 0,05 |
| **British Transco International Finance BV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.11.2021 | | 300 | 282 | 0,02 |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2024 | | 50 | 53 | 0,00 |
| 4,700 % fällig am 20.09.2047 | | 500 | 523 | 0,03 |
| **Capital One Financial Corp.** | | | | |
| 3,295 % fällig am 12.05.2020 | | 200 | 201 | 0,01 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 16.02.2024 | | 500 | 532 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 07.03.2025 | | 400 | 439 | 0,03 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 23.07.2021 | | 1.000 | 1.022 | 0,07 |
| 3,650 % fällig am 23.01.2024 | | 2.100 | 2.213 | 0,14 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,876 % fällig am 24.07.2023 | | 600 | 608 | 0,04 |
| 3,540 % fällig am 25.04.2022 | | 100 | 101 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 17.05.2024 | | 300 | 303 | 0,02 |
| 3,950 % fällig am 01.09.2023 | | 1.600 | 1.630 | 0,10 |
| 4,044 % fällig am 01.06.2024 | | 1.400 | 1.481 | 0,09 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 19.01.2021 | | 250 | 251 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 26.09.2023 | | 750 | 792 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (f)(h) | € | 2.720 | 3.229 | 0,21 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (f)(h) | | 600 | 758 | 0,05 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | | 2.500 | 2.920 | 0,19 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 1.600 | 1.658 | 0,11 |
| 4,875 % fällig am 16.07.2025 (f) | € | 2.200 | 2.484 | 0,16 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | $ | 1.200 | 1.324 | 0,08 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 1,000 % fällig am 24.06.2027 | € | 500 | 578 | 0,04 |
| 2,125 % fällig am 12.09.2025 | £ | 200 | 253 | 0,02 |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | $ | 2.200 | 2.270 | 0,14 |
| **Credit Suisse Group Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 150 | 157 | 0,01 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | | 1.000 | 1.089 | 0,07 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.02.2021 | | 600 | 608 | 0,04 |
| 4,875 % fällig am 15.04.2022 | | 300 | 319 | 0,02 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 1.000 | 1.149 | 0,07 |
| 3,150 % fällig am 22.01.2021 | $ | 800 | 794 | 0,05 |
| 3,567 % fällig am 13.07.2020 | | 100 | 99 | 0,01 |
| 3,715 % fällig am 16.11.2022 | | 800 | 773 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 04.02.2021 | | 1.100 | 1.110 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 300 | 304 | 0,02 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | € | 2.200 | 2.737 | 0,17 |
| **Dream Global Funding SARL** | | | | |
| 1,750 % fällig am 28.06.2026 | | 3.700 | 4.261 | 0,27 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | | 500 | 558 | 0,04 |
| 3,273 % fällig am 24.09.2020 | $ | 2.900 | 2.898 | 0,18 |
| 3,408 % fällig am 05.04.2021 | | 400 | 395 | 0,03 |
| 3,600 % fällig am 28.03.2022 | $ | 300 | $ 295 | 0,02 |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 | | 1.800 | 1.833 | 0,12 |
| 5,729 % fällig am 07.01.2022 | | 300 | 309 | 0,02 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 04.11.2020 | £ | 2.100 | 2.825 | 0,18 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 0,207 % fällig am 26.03.2022 | € | 600 | 675 | 0,04 |
| 3,442 % fällig am 09.04.2021 | $ | 700 | 700 | 0,04 |
| 3,588 % fällig am 05.01.2023 | | 400 | 394 | 0,03 |
| 3,640 % fällig am 30.06.2022 | | 500 | 500 | 0,03 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 3.100 | 3.758 | 0,24 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 2,876 % fällig am 31.10.2022 | $ | 900 | 908 | 0,06 |
| 3,200 % fällig am 23.02.2023 | | 1.100 | 1.126 | 0,07 |
| 3,581 % fällig am 24.07.2023 | | 600 | 601 | 0,04 |
| 3,691 % fällig am 05.06.2028 | | 100 | 103 | 0,01 |
| 3,696 % fällig am 26.04.2022 | | 300 | 303 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 50 | 52 | 0,00 |
| 4,125 % fällig am 29.11.2023 | | 1.400 | 1.438 | 0,09 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | | |
| 3,460 % fällig am 02.03.2021 | | 2.000 | 1.998 | 0,13 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.12.2024 | € | 1.800 | 2.157 | 0,14 |
| 3,000 % fällig am 22.07.2028 | £ | 2.300 | 3.056 | 0,19 |
| 3,520 % fällig am 18.05.2024 | $ | 500 | 502 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 28.09.2026 (f)(h) | £ | 1.300 | 1.741 | 0,11 |
| 6,250 % fällig am 23.03.2023 (f)(h) | $ | 300 | 309 | 0,02 |
| **IMMOFINANZ AG** | | | | |
| 2,625 % fällig am 27.01.2023 | € | 2.500 | 2.978 | 0,19 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.04.2021 | $ | 200 | 206 | 0,01 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 1.200 | 1.295 | 0,08 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (f)(h) | € | 300 | 385 | 0,02 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 22.05.2024 | | 2.500 | 2.960 | 0,19 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,776 % fällig am 25.04.2023 | $ | 1.300 | 1.313 | 0,08 |
| 3,220 % fällig am 01.03.2025 | | 100 | 103 | 0,01 |
| 3,480 % fällig am 25.04.2023 | | 1.100 | 1.106 | 0,07 |
| 3,797 % fällig am 23.07.2024 | | 600 | 630 | 0,04 |
| 3,811 % fällig am 24.10.2023 | | 1.500 | 1.524 | 0,10 |
| 3,900 % fällig am 15.07.2025 | | 50 | 53 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 2,604 % fällig am 01.02.2021 | | 1.600 | 1.602 | 0,10 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK | 27.000 | 4.136 | 0,26 |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 05.03.2024 (f)(h) | € | 2.600 | 3.145 | 0,20 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025 | | 3.000 | 3.539 | 0,23 |
| 3,950 % fällig am 30.06.2022 | £ | 2.200 | 2.868 | 0,18 |
| **Kennedy-Wilson, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.04.2024 | $ | 1.000 | 1.025 | 0,07 |
| **Lazard Group LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 11.03.2029 | | 1.500 | 1.587 | 0,10 |
| 4,500 % fällig am 19.09.2028 | | 4.000 | 4.264 | 0,27 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | € | 1.000 | 1.135 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 11.01.2027 | $ | 5.000 | 5.095 | 0,32 |
| 4,375 % fällig am 22.03.2028 | | 400 | 425 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (f)(h) | £ | 300 | 434 | 0,03 |
| **LoanCore Capital Markets LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.06.2020 | $ | 250 | 249 | 0,02 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.04.2021 | € | 1.000 | 1.149 | 0,07 |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | | 2.000 | 2.527 | 0,16 |
| **Mid-America Apartments LP** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.06.2027 | $ | 600 | 620 | 0,04 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,190 % fällig am 13.09.2021 | | 50 | 50 | 0,00 |
| 3,535 % fällig am 26.07.2021 | | 1.000 | 1.023 | 0,07 |
| **Mizuho Bank Ltd.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 26.03.2020 | | 400 | 400 | 0,03 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,590 % fällig am 13.09.2021 | | 50 | 51 | 0,00 |
| 3,922 % fällig am 11.09.2024 | | 400 | 419 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Morgan Stanley** | | | | | |
| 0,637 % fällig am 26.07.2024 | € | 1.700 | $ | 1.957 | 0,12 |
| 3,095 % fällig am 10.02.2021 | $ | 500 | | 501 | 0,03 |
| 3,125 % fällig am 23.01.2023 | | 200 | | 205 | 0,01 |
| 3,249 % fällig am 10.06.2022 | | 2.500 | | 2.504 | 0,16 |
| 3,772 % fällig am 20.01.2022 | | 1.400 | | 1.415 | 0,09 |
| 3,981 % fällig am 24.10.2023 | | 300 | | 306 | 0,02 |
| **MUFG Bank Ltd.** | | | | | |
| 2,300 % fällig am 05.03.2020 | | 400 | | 400 | 0,03 |
| **Nationstar Mortgage Holdings, Inc.** | | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.07.2023 | | 1.300 | | 1.329 | 0,08 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 1.100 | | 1.123 | 0,07 |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | | 2.000 | | 2.094 | 0,13 |
| **Navient Corp.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 26.10.2020 | | 300 | | 307 | 0,02 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 200 | | 207 | 0,01 |
| **NE Property BV** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.05.2023 | € | 1.500 | | 1.755 | 0,11 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | | |
| 2,150 % fällig am 28.09.2020 | $ | 400 | | 398 | 0,03 |
| 2,600 % fällig am 28.09.2022 | | 200 | | 199 | 0,01 |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | | 1.100 | | 1.097 | 0,07 |
| 3,016 % fällig am 21.09.2021 | | 700 | | 700 | 0,04 |
| 3,150 % fällig am 15.03.2021 | | 1.400 | | 1.412 | 0,09 |
| 3,247 % fällig am 13.07.2022 | | 700 | | 697 | 0,04 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK | 51.700 | | 7.920 | 0,50 |
| **Oxford Finance LLC** | | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.12.2022 | $ | 400 | | 412 | 0,03 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 4.000 | | 4.010 | 0,26 |
| **Regions Bank** | | | | | |
| 3,035 % fällig am 13.08.2021 | | 1.400 | | 1.399 | 0,09 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | € | 4.100 | | 4.853 | 0,31 |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | $ | 400 | | 399 | 0,03 |
| 3,988 % fällig am 15.05.2023 | | 200 | | 200 | 0,01 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | | 700 | | 748 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (f)(h) | | 2.050 | | 2.106 | 0,13 |
| 8,000 % fällig am 10.08.2025 (f)(h) | | 300 | | 325 | 0,02 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (f)(h) | | 2.700 | | 2.917 | 0,19 |
| **Sagax AB** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.01.2024 | € | 2.500 | | 2.958 | 0,19 |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | | 2.900 | | 3.440 | 0,22 |
| **Samhallsbyggnadsbolaget Norden AB** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 14.01.2025 | | 1.300 | | 1.507 | 0,10 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 28.03.2022 | $ | 100 | | 102 | 0,01 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 0,505 % fällig am 27.03.2024 | € | 2.600 | | 2.911 | 0,19 |
| 4,796 % fällig am 15.11.2024 | $ | 4.700 | | 4.997 | 0,32 |
| **Santander UK PLC** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 18.06.2024 | | 2.400 | | 2.416 | 0,15 |
| **SL Green Operating Partnership LP** | | | | | |
| 3,505 % fällig am 16.08.2021 | | 1.000 | | 1.000 | 0,06 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | | 500 | | 532 | 0,03 |
| 6,125 % fällig am 15.05.2022 | | 100 | | 108 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 2.800 | | 3.017 | 0,19 |
| 7,750 % fällig am 01.10.2021 | | 100 | | 110 | 0,01 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 200 | | 215 | 0,01 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | | |
| 3,650 % fällig am 19.08.2019 | | 50 | | 50 | 0,00 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (f) | € | 450 | | 629 | 0,04 |
| **Synchrony Bank** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2022 | $ | 250 | | 252 | 0,02 |
| **TLG Immobilien AG** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 28.05.2026 | € | 4.000 | | 4.559 | 0,29 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | | |
| 3,589 % fällig am 07.04.2021 | $ | 100 | | 101 | 0,01 |
| **TP ICAP PLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | £ | 1.400 | | 1.825 | 0,12 |
| **U.S. Bank N.A.** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 24.07.2023 | $ | 2.400 | | 2.505 | 0,16 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 3,031 % fällig am 08.06.2020 | $ | 1.400 | $ | 1.408 | 0,09 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h) | | 100 | | 106 | 0,01 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (h) | | 500 | | 561 | 0,04 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | | |
| 2,859 % fällig am 15.08.2023 | | 2.800 | | 2.826 | 0,18 |
| 7,125 % fällig am 19.02.2020 (f)(h) | | 1.300 | | 1.327 | 0,08 |
| **UniCredit SpA** | | | | | |
| 6,497 % fällig am 14.01.2022 | | 2.200 | | 2.289 | 0,15 |
| 6,625 % fällig am 03.06.2023 (f)(h) | € | 700 | | 796 | 0,05 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 2.650 | | 3.029 | 0,19 |
| 9,250 % fällig am 03.06.2022 (f)(h) | € | 800 | | 1.021 | 0,07 |
| **VEREIT Operating Partnership LP** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.08.2027 | $ | 3.000 | | 3.094 | 0,20 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.05.2027 | € | 1.700 | | 2.024 | 0,13 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 01.04.2022 | | 2.500 | | 2.873 | 0,18 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | | |
| 0,500 % fällig am 20.06.2022 | | 2.700 | | 3.089 | 0,20 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 3,069 % fällig am 24.01.2023 | $ | 200 | | 203 | 0,01 |
| 3,813 % fällig am 31.10.2023 | | 2.600 | | 2.651 | 0,17 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | | | |
| 3,550 % fällig am 14.08.2023 | | 2.500 | | 2.611 | 0,17 |
| | | | | 290.336 | 18,51 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | | |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.09.2021 | | 1.400 | | 1.398 | 0,09 |
| **Allergan Funding SCS** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.03.2020 | | 1.100 | | 1.103 | 0,07 |
| **Allergan Sales LLC** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.02.2021 | | 300 | | 309 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 15.12.2021 | | 400 | | 418 | 0,03 |
| **Alliance Data Systems Corp.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.11.2021 | | 30 | | 31 | 0,00 |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 | | 200 | | 204 | 0,01 |
| **Amazon.com, Inc.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 22.08.2057 | | 400 | | 462 | 0,03 |
| **AMC Networks, Inc.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.08.2025 | | 100 | | 101 | 0,01 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.04.2030 | | 22 | | 22 | 0,00 |
| **Amgen, Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 22.05.2024 | | 2.700 | | 2.838 | 0,18 |
| **ANR Pipeline Co.** | | | | | |
| 9,625 % fällig am 01.11.2021 | | 600 | | 693 | 0,04 |
| **AutoNation, Inc.** | | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.01.2021 | | 400 | | 404 | 0,03 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 03.07.2023 | € | 2.400 | | 2.925 | 0,19 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | | |
| 3,222 % fällig am 15.08.2024 | $ | 100 | | 101 | 0,01 |
| 4,540 % fällig am 15.08.2047 | | 500 | | 465 | 0,03 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 12.03.2024 | £ | 1.800 | | 2.820 | 0,18 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.10.2021 | $ | 300 | | 302 | 0,02 |
| **B.C. Unlimited Liability Co.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2024 | | 700 | | 710 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2025 | | 100 | | 101 | 0,01 |
| **Berry Global, Inc.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.02.2026 | | 300 | | 296 | 0,02 |
| **Boral Finance Pty. Ltd.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.11.2022 | | 100 | | 100 | 0,01 |
| **Braskem Finance Ltd.** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.04.2021 | | 200 | | 210 | 0,01 |
| **Broadcom Corp.** | | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.01.2021 | | 800 | | 793 | 0,05 |
| 2,650 % fällig am 15.01.2023 | | 800 | | 789 | 0,05 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2022 | | 700 | | 702 | 0,04 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2021 | | 600 | | 604 | 0,04 |
| 3,125 % fällig am 15.10.2022 | | 2.400 | | 2.416 | 0,15 |
| **CA, Inc.** | | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.08.2020 | $ | 800 | $ | 805 | 0,05 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 02.08.2022 | | 600 | | 597 | 0,04 |
| 3,650 % fällig am 15.03.2023 | | 1.100 | | 1.133 | 0,07 |
| 3,950 % fällig am 15.03.2025 | | 2.500 | | 2.602 | 0,17 |
| **Cardinal Health, Inc.** | | | | | |
| 3,180 % fällig am 15.06.2022 | | 200 | | 201 | 0,01 |
| **Central Japan Railway Co.** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 06.09.2023 | | 400 | | 415 | 0,03 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 1.500 | | 1.577 | 0,10 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 3.270 | | 3.553 | 0,23 |
| 5,375 % fällig am 01.04.2038 | | 800 | | 858 | 0,05 |
| **Cheniere Corpus Christi Holdings LLC** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 31.03.2025 | | 20 | | 22 | 0,00 |
| **Cigna Corp.** | | | | | |
| 3,487 % fällig am 15.07.2023 | | 300 | | 300 | 0,02 |
| **Cigna Holding Co.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.06.2020 | | 800 | | 820 | 0,05 |
| **Cleveland-Cliffs, Inc.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2024 | | 300 | | 305 | 0,02 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | | |
| 3,092 % fällig am 09.10.2020 | | 500 | | 499 | 0,03 |
| 3,342 % fällig am 22.10.2020 | | 900 | | 900 | 0,06 |
| **Constellation Brands, Inc.** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 07.11.2022 | | 1.000 | | 1.004 | 0,06 |
| 3,218 % fällig am 15.11.2021 | | 2.100 | | 2.101 | 0,13 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(c) | | 804 | | 386 | 0,02 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (9,000 % bar und 0,500 % PIK)** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(c) | | 302 | | 145 | 0,01 |
| **Core & Main LP** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.08.2025 | | 100 | | 101 | 0,01 |
| **Cornerstone Building Brands, Inc.** | | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.04.2026 | | 1.400 | | 1.368 | 0,09 |
| **Covidien International Finance S.A.** | | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.06.2022 | | 100 | | 103 | 0,01 |
| **CRH America Finance, Inc.** | | | | | |
| 3,400 % fällig am 09.05.2027 | | 100 | | 100 | 0,01 |
| **CVS Health Corp.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.12.2022 | | 200 | | 201 | 0,01 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2022 | | 300 | | 313 | 0,02 |
| **DAE Funding LLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | | 650 | | 678 | 0,04 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | | |
| 3,350 % fällig am 04.05.2021 | | 400 | | 406 | 0,03 |
| 3,400 % fällig am 22.02.2022 | | 400 | | 408 | 0,03 |
| **Danone S.A.** | | | | | |
| 2,077 % fällig am 02.11.2021 | | 1.500 | | 1.491 | 0,09 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 1.400 | | 1.443 | 0,09 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 2.300 | | 2.480 | 0,16 |
| 6,020 % fällig am 15.06.2026 | | 250 | | 276 | 0,02 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | | |
| 2,820 % fällig am 19.01.2022 | | 1.000 | | 1.009 | 0,06 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | | 100 | | 101 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 1.900 | | 1.912 | 0,12 |
| **Dometic Group AB** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.05.2026 | € | 2.000 | | 2.294 | 0,15 |
| **DXC Technology Co.** | | | | | |
| 3,470 % fällig am 01.03.2021 | $ | 385 | | 385 | 0,02 |
| **Enbridge (U.S.), Inc.** | | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 1.000 | | 1.000 | 0,06 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | | 500 | | 509 | 0,03 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2022 | | 200 | | 213 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | | 200 | | 206 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2022 | | 60 | | 64 | 0,00 |
| **Equifax, Inc.** | | | | | |
| 3,388 % fällig am 15.08.2021 | | 700 | | 698 | 0,04 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Libor Plus Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 16.08.2021 | $ | 200 | $ 209 | 0,01 |
| **Exela Intermediate LLC** | | | | |
| 10,000 % fällig am 15.07.2023 | | 300 | 245 | 0,02 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 01.07.2023 (b) | € | 2.000 | 2.293 | 0,15 |
| 1,125 % fällig am 01.07.2027 (b) | | 1.400 | 1.617 | 0,10 |
| 1,625 % fällig am 01.07.2030 (b) | | 2.100 | 2.450 | 0,16 |
| **GATX Corp.** | | | | |
| 3,285 % fällig am 05.11.2021 | $ | 3.000 | 2.988 | 0,19 |
| **General Mills, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 17.10.2023 | | 600 | 629 | 0,04 |
| **Georgia-Pacific LLC** | | | | |
| 5,400 % fällig am 01.11.2020 | | 500 | 520 | 0,03 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | £ | 408 | 603 | 0,04 |
| **Harris Corp.** | | | | |
| 3,063 % fällig am 30.04.2020 | $ | 1.500 | 1.500 | 0,10 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.10.2019 | | 100 | 100 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2020 | | 500 | 512 | 0,03 |
| **Heathrow Finance PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.03.2024 | £ | 1.500 | 2.013 | 0,13 |
| **Hewlett Packard Enterprise Co.** | | | | |
| 3,318 % fällig am 05.10.2021 | $ | 700 | 700 | 0,04 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2026 | | 1.400 | 1.465 | 0,09 |
| **Huntsman International LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.11.2022 | | 700 | 741 | 0,05 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c) | € | 2.900 | 3.384 | 0,22 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (c) | | 1.100 | 1.273 | 0,08 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (c) | | 1.800 | 2.086 | 0,13 |
| **Incitec Pivot Finance LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 10.12.2019 | $ | 100 | 101 | 0,01 |
| **INEOS Finance PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.05.2026 | € | 3.200 | 3.699 | 0,24 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 05.07.2023 | | 400 | 474 | 0,03 |
| **Japan Tobacco, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 13.04.2021 | $ | 600 | 595 | 0,04 |
| **Kansas City Southern** | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.06.2026 | | 200 | 196 | 0,01 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2021 | | 100 | 104 | 0,01 |
| **KLA-Tencor Corp.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.11.2021 | | 400 | 414 | 0,03 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | | |
| 2,437 % fällig am 11.09.2022 | | 200 | 200 | 0,01 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.06.2026 | | 200 | 195 | 0,01 |
| 3,365 % fällig am 10.08.2022 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Marathon Oil Corp.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.11.2022 | | 1.100 | 1.105 | 0,07 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 06.12.2021 | £ | 2.000 | 2.799 | 0,18 |
| **Marvell Technology Group Ltd.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 22.06.2023 | $ | 900 | 938 | 0,06 |
| **McDonald's Corp.** | | | | |
| 3,012 % fällig am 28.10.2021 | | 1.700 | 1.702 | 0,11 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 5,250 % fällig am 31.03.2020 | | 100 | 102 | 0,01 |
| 6,625 % fällig am 15.12.2021 | | 100 | 108 | 0,01 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | | |
| 3,922 % fällig am 01.06.2021 | | 100 | 102 | 0,01 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | |
| 4,640 % fällig am 06.02.2024 | | 3.700 | 3.861 | 0,25 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | £ | 1.718 | 2.485 | 0,16 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.10.2021 | $ | 1.000 | 991 | 0,06 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | |
| 0,375 % fällig am 03.01.2026 (b) | € | 3.700 | 4.226 | 0,27 |
| 2,375 % fällig am 03.07.2039 (b) | £ | 1.400 | 1.744 | 0,11 |
| **Murphy Oil Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.08.2025 | $ | 100 | $ 104 | 0,01 |
| **Mylan NV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 22.11.2024 | € | 2.500 | 2.904 | 0,18 |
| 3,150 % fällig am 15.06.2021 | $ | 500 | 500 | 0,03 |
| 3,750 % fällig am 15.12.2020 | | 2.700 | 2.726 | 0,17 |
| 3,950 % fällig am 15.06.2026 | | 200 | 194 | 0,01 |
| **Next Group PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 26.08.2025 | £ | 800 | 1.044 | 0,07 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 21.07.2021 | $ | 800 | 793 | 0,05 |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | | 2.200 | 2.256 | 0,14 |
| 4,625 % fällig am 15.06.2022 | | 2.900 | 3.045 | 0,19 |
| 4,625 % fällig am 01.06.2023 | | 1.300 | 1.374 | 0,09 |
| **Owens Corning** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.12.2022 | | 600 | 625 | 0,04 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2021 | | 500 | 506 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 4.000 | 4.233 | 0,27 |
| **Penske Automotive Group, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.08.2020 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 3,300 % fällig am 01.04.2021 | | 500 | 506 | 0,03 |
| 3,950 % fällig am 10.03.2025 | | 800 | 840 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 17.01.2023 | | 600 | 631 | 0,04 |
| **Pernod Ricard S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.04.2021 | | 200 | 211 | 0,01 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 3,750 % fällig am 21.02.2024 | € | 300 | 341 | 0,02 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.01.2021 | $ | 20 | 20 | 0,00 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | |
| 2,903 % fällig am 24.06.2022 | | 800 | 798 | 0,05 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.06.2022 | | 100 | 104 | 0,01 |
| **Rolls-Royce PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.10.2020 | | 300 | 300 | 0,02 |
| **Ryder System, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.09.2022 | | 500 | 501 | 0,03 |
| 2,650 % fällig am 02.03.2020 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | | 500 | 549 | 0,03 |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 2.400 | 2.494 | 0,16 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 200 | 223 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 30.06.2026 | | 2.500 | 2.859 | 0,18 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | | 1.700 | 1.790 | 0,11 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 1.000 | 1.181 | 0,08 |
| **Shire Acquisitions Investments Ireland DAC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 23.09.2023 | $ | 800 | 808 | 0,05 |
| **Southern Co.** | | | | |
| 2,350 % fällig am 01.07.2021 | | 400 | 400 | 0,03 |
| 2,950 % fällig am 01.07.2023 | | 400 | 406 | 0,03 |
| **Spectra Energy Partners LP** | | | | |
| 3,179 % fällig am 05.06.2020 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 3,210 % fällig am 15.06.2021 | | 100 | 99 | 0,01 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2028 | | 2.200 | 2.310 | 0,15 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 3,360 % fällig am 20.03.2023 | | 394 | 395 | 0,03 |
| **Sunoco Logistics Partners Operations LP** | | | | |
| 4,400 % fällig am 01.04.2021 | | 200 | 206 | 0,01 |
| 5,300 % fällig am 01.04.2044 | | 500 | 515 | 0,03 |
| **Sunoco LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2023 | | 200 | 205 | 0,01 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,125 % fällig am 28.03.2022 | | 200 | 200 | 0,01 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 26.11.2023 | | 200 | 214 | 0,01 |
| **Teleperformance** | | | | |
| 1,500 % fällig am 03.04.2024 | € | 1.000 | 1.180 | 0,08 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Co. BV** | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | $ | 100 | 97 | 0,01 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,250 % fällig am 31.03.2023 | € | 5.600 | $ 5.700 | 0,36 |
| 2,200 % fällig am 21.07.2021 | $ | 800 | 762 | 0,05 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2022 | € | 900 | 1.014 | 0,06 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.04.2023 | $ | 1.400 | 1.437 | 0,09 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.09.2021 | | 300 | 308 | 0,02 |
| **Toyota Industries Corp.** | | | | |
| 3,110 % fällig am 12.03.2022 | | 2.200 | 2.240 | 0,14 |
| **Toyota Motor Corp.** | | | | |
| 2,157 % fällig am 02.07.2022 (b) | | 2.300 | 2.301 | 0,15 |
| **Toyota Tsusho Corp.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 13.09.2023 | | 1.000 | 1.041 | 0,07 |
| **TransCanada PipeLines Ltd.** | | | | |
| 9,875 % fällig am 01.01.2021 | | 300 | 332 | 0,02 |
| **Transocean, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 700 | 666 | 0,04 |
| **Transurban Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 16.05.2029 | € | 1.000 | 1.194 | 0,08 |
| **Tyson Foods, Inc.** | | | | |
| 2,972 % fällig am 21.08.2020 | $ | 200 | 200 | 0,01 |
| **UCB S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.04.2022 | € | 700 | 830 | 0,05 |
| **United Technologies Corp.** | | | | |
| 3,175 % fällig am 16.08.2021 | $ | 1.400 | 1.401 | 0,09 |
| **Valvoline, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.08.2025 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **ViaSat, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2025 | | 300 | 296 | 0,02 |
| **Viking Cruises Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2027 | | 100 | 101 | 0,01 |
| **Virgin Media Receivables Financing Notes DAC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.09.2024 | £ | 800 | 1.055 | 0,07 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 21.08.2027 | $ | 900 | 914 | 0,06 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.11.2021 | | 700 | 723 | 0,05 |
| **Vulcan Materials Co.** | | | | |
| 3,170 % fällig am 01.03.2021 | | 200 | 200 | 0,01 |
| **Wabtec Corp.** | | | | |
| 3,710 % fällig am 15.09.2021 | | 200 | 199 | 0,01 |
| **West Street Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.09.2025 | | 250 | 232 | 0,01 |
| **Western Digital Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2026 | | 700 | 688 | 0,04 |
| **Zoetis, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 20.08.2021 | | 800 | 813 | 0,05 |
| | | | 174.602 | 11,13 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Antero Midstream Partners LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | | 2.500 | 2.506 | 0,16 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | | 600 | 603 | 0,04 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 200 | 202 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 01.03.2027 | | 600 | 644 | 0,04 |
| 5,150 % fällig am 15.02.2050 | | 300 | 332 | 0,02 |
| **Baltimore Gas & Electric Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.11.2021 | | 200 | 205 | 0,01 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 09.12.2020 | | 200 | 205 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 15.10.2021 | | 300 | 310 | 0,02 |
| **BP Capital Markets America, Inc.** | | | | |
| 2,520 % fällig am 19.09.2022 | | 600 | 605 | 0,04 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.12.2023 | | 200 | 214 | 0,01 |
| **Centrais Eletricas Brasileiras S.A.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 27.10.2021 | | 400 | 419 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 30.07.2019 | | 200 | 201 | 0,01 |
| **Consolidated Edison Co. of New York, Inc.** | | | | |
| 2,749 % fällig am 25.06.2021 | | 600 | 602 | 0,04 |
| **Drax Finco PLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.11.2025 | | 2.000 | 2.054 | 0,13 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Duke Energy Corp.** | | | | |
| 3,028 % fällig am 14.05.2021 | $ | 1.500 | $ 1.504 | 0,10 |
| 3,750 % fällig am 15.04.2024 | | 1.700 | 1.795 | 0,12 |
| **Duquesne Light Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,400 % fällig am 15.09.2020 | | 400 | 417 | 0,03 |
| **Emera U.S. Finance LP** | | | | |
| 2,700 % fällig am 15.06.2021 | | 500 | 502 | 0,03 |
| **Enable Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.05.2028 | | 700 | 734 | 0,05 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 3,625 % fällig am 25.05.2027 | | 200 | 201 | 0,01 |
| **Eutelsat S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.07.2027 | € | 3.000 | 3.489 | 0,22 |
| **Exelon Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.06.2020 | $ | 100 | 100 | 0,01 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.03.2023 | | 50 | 53 | 0,00 |
| **London Power Networks PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.03.2029 | £ | 1.500 | 2.000 | 0,13 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 30.06.2021 | $ | 1.300 | 1.304 | 0,08 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,241 % fällig am 25.02.2022 | | 2.800 | 2.817 | 0,18 |
| 3,342 % fällig am 01.09.2020 | | 1.000 | 1.012 | 0,06 |
| 3,625 % fällig am 15.06.2023 | | 1.300 | 1.352 | 0,09 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 13.07.2027 | | 3.000 | 3.121 | 0,20 |
| 4,350 % fällig am 15.03.2029 | | 2.000 | 2.139 | 0,14 |
| **PECO Energy Co.** | | | | |
| 1,700 % fällig am 15.09.2021 | | 900 | 892 | 0,06 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,999 % fällig am 27.01.2028 | | 3.480 | 3.704 | 0,24 |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 68 | 73 | 0,01 |
| 8,750 % fällig am 23.05.2026 | | 2.100 | 2.597 | 0,17 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2021 | | 500 | 515 | 0,03 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | | 500 | 563 | 0,04 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 585 | 654 | 0,04 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 181 | 208 | 0,01 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 650 | 648 | 0,04 |
| 3,097 % fällig am 15.01.2021 | | 500 | 498 | 0,03 |
| **Southern Power Co.** | | | | |
| 2,937 % fällig am 20.12.2020 | | 1.100 | 1.100 | 0,07 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.03.2020 | | 800 | 822 | 0,05 |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 1.100 | 1.143 | 0,07 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 200 | 213 | 0,01 |
| 7,625 % fällig am 01.03.2026 | | 800 | 855 | 0,05 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.10.2023 | | 1.000 | 1.018 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 15.09.2024 | | 20 | 21 | 0,00 |
| **Tampa Electric Co.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.09.2022 | | 300 | 301 | 0,02 |
| **Telstra Corp. Ltd.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 12.10.2021 | | 100 | 105 | 0,01 |
| | | | 47.572 | 3,04 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 512.510 | 32,68 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **California State General Obligation Bonds, Series 2017** | | | | |
| 2,193 % fällig am 01.04.2047 | | 50 | 50 | 0,00 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.06.2047 (d) | | 4.700 | 288 | 0,02 |
| | | | 338 | 0,02 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae UMBS** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2047 - 01.05.2049 | | 100.757 | 103.543 | 6,60 |
| 4,000 % fällig am 01.03.2049 | | 20.778 | 21.479 | 1,37 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 92.200 | 94.252 | 6,01 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2049 | $ | 7.297 | $ 7.479 | 0,48 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2045 | | 26.501 | 27.642 | 1,76 |
| | | | 254.395 | 16,22 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.08.2047 | | 200 | 209 | 0,01 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2021 | | 23.717 | 23.501 | 1,50 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | | 108 | 108 | 0,01 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | | 8.356 | 8.437 | 0,54 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | | 5.076 | 5.160 | 0,33 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | | 6.688 | 6.852 | 0,44 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | | 9.263 | 9.655 | 0,61 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | | 43.005 | 45.285 | 2,89 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | | 8.049 | 9.028 | 0,57 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | | 13 | 14 | 0,00 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 | | 3.118 | 3.485 | 0,22 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2027 | | 13.810 | 15.956 | 1,02 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 | | 1.940 | 2.335 | 0,15 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 1,750 % fällig am 30.06.2022 | | 1.100 | 1.102 | 0,07 |
| 1,875 % fällig am 15.12.2020 | | 16.600 | 16.610 | 1,06 |
| 1,875 % fällig am 31.08.2022 | | 34.500 | 34.660 | 2,21 |
| 2,000 % fällig am 31.01.2020 | | 20.800 | 20.795 | 1,33 |
| 2,000 % fällig am 31.10.2022 | | 3.200 | 3.228 | 0,21 |
| 2,000 % fällig am 30.11.2022 | | 26.940 | 27.187 | 1,73 |
| 2,000 % fällig am 31.05.2024 | | 15.800 | 15.987 | 1,02 |
| 2,125 % fällig am 31.05.2026 | | 23.200 | 23.590 | 1,50 |
| 2,250 % fällig am 30.04.2024 | | 21.700 | 22.195 | 1,41 |
| 2,375 % fällig am 31.01.2023 | | 65.900 | 67.381 | 4,30 |
| 2,375 % fällig am 29.02.2024 | | 16.200 | 16.658 | 1,06 |
| 2,500 % fällig am 28.02.2021 | | 6.900 | 6.978 | 0,44 |
| | | | 386.396 | 24,63 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 4,160 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 568 | 518 | 0,03 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,984 % fällig am 25.11.2045 | | 919 | 907 | 0,06 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 2,543 % fällig am 20.02.2047 | | 1.529 | 1.526 | 0,10 |
| 2,763 % fällig am 20.07.2036 | | 2.828 | 2.792 | 0,18 |
| 5,912 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 19 | 18 | 0,00 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 2,557 % fällig am 26.11.2036 | | 621 | 592 | 0,04 |
| 2,584 % fällig am 25.03.2037 | | 107 | 106 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 4,719 % fällig am 25.01.2035 | | 34 | 35 | 0,00 |
| 4,910 % fällig am 25.02.2036 | | 37 | 36 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 4,100 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 128 | 84 | 0,01 |
| **Brunel Residential Mortgage Securitisation PLC** | | | | |
| 1,041 % fällig am 13.01.2039 | £ | 2.867 | 3.582 | 0,23 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 4,550 % fällig am 25.09.2035 | $ | 20 | 21 | 0,00 |
| **Clavis Securities PLC** | | | | |
| 0,956 % fällig am 15.12.2032 | £ | 373 | 457 | 0,03 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.04.2047 | $ | 595 | 569 | 0,04 |
| 2,564 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 54 | 54 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2047 | | 74 | 73 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 488 | 478 | 0,03 |
| 2,614 % fällig am 25.07.2046 | | 21 | 21 | 0,00 |
| 3,504 % fällig am 25.12.2035 | | 103 | 94 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.04.2035 | | 1.839 | 1.579 | 0,10 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2036 | | 125 | 92 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 201 | 167 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 592 | 423 | 0,03 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 21 | 19 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 974 | 850 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 25.08.2037 | | 1.175 | 1.041 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 556 | 470 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 12 | 9 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 2,977 % fällig am 30.11.2037 | | 270 | 269 | 0,02 |
| **Domi BV** | | | | |
| 0,553 % fällig am 15.06.2051 | € | 2.800 | $ 3.191 | 0,20 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,580 % fällig am 19.10.2036 | $ | 723 | 647 | 0,04 |
| **EMF-UK PLC** | | | | |
| 1,769 % fällig am 13.03.2046 | £ | 70 | 89 | 0,01 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 0,936 % fällig am 15.06.2044 | | 35 | 42 | 0,00 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,910 % fällig am 16.06.2069 | | 1.400 | 1.786 | 0,11 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,931 % fällig am 18.06.2038 | | 106 | 132 | 0,01 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.03.2035 | $ | 155 | 145 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 | | 2.665 | 2.390 | 0,15 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,504 % fällig am 19.10.2035 | | 720 | 559 | 0,04 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 0 | 17 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.08.2046 | | 453 | 439 | 0,03 |
| 2,629 % fällig am 25.08.2046 | | 775 | 742 | 0,05 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 1,436 % fällig am 15.12.2049 | £ | 29 | 36 | 0,00 |
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | | |
| 2,450 % fällig am 25.05.2042 | $ | 717 | 661 | 0,04 |
| **Mortimer BTL** | | | | |
| 2,009 % fällig am 20.06.2051 | £ | 3.100 | 3.952 | 0,25 |
| **Mulcair Securities DAC** | | | | |
| 0,695 % fällig am 24.04.2071 | € | 2.500 | 2.852 | 0,18 |
| **NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.02.2035 ^ | $ | 856 | 878 | 0,06 |
| **New Century Alternative Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 5,074 % fällig am 25.10.2036 | | 658 | 306 | 0,02 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,836 % fällig am 25.09.2046 | | 2.771 | 1.345 | 0,09 |
| **OBX Trust** | | | | |
| 3,054 % fällig am 25.06.2057 | | 599 | 597 | 0,04 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,760 % fällig am 15.05.2045 (b) | £ | 3.100 | 3.948 | 0,25 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,400 % fällig am 13.08.2057 | AUD | 776 | 544 | 0,03 |
| 2,511 % fällig am 16.09.2059 | | 792 | 554 | 0,04 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.06.2036 ^ | $ | 42 | 38 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 319 | 300 | 0,02 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.06.2037 | | 2.930 | 1.312 | 0,08 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,582 % fällig am 20.03.2050 | £ | 586 | 744 | 0,05 |
| 1,732 % fällig am 20.12.2046 | | 336 | 427 | 0,03 |
| 1,982 % fällig am 20.09.2065 | | 1.285 | 1.644 | 0,10 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 3,280 % fällig am 16.12.2059 | $ | 1.003 | 1.004 | 0,06 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | |
| 0,943 % fällig am 12.06.2044 | £ | 41 | 49 | 0,00 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,457 % fällig am 21.01.2070 | | 3.100 | 3.954 | 0,25 |
| 3,148 % fällig am 21.01.2070 | $ | 800 | 803 | 0,05 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.09.2047 | | 1.514 | 1.469 | 0,09 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,654 % fällig am 20.05.2045 | £ | 1.182 | 1.505 | 0,10 |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 9.100 | 11.626 | 0,74 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,971 % fällig am 15.07.2051 | | 431 | 551 | 0,04 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,781 % fällig am 12.12.2052 | | 1.400 | 1.780 | 0,11 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 3,957 % fällig am 25.02.2037 ^ | $ | 191 | 191 | 0,01 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 159 | 90 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Libor Plus Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,991 % fällig am 25.07.2034 | $ 37 | $ 38 | 0,00 |
| 4,991 % fällig am 25.03.2036 ^ | 32 | 32 | 0,00 |
| | | 70.291 | 4,48 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,664 % fällig am 25.09.2036 | 2.152 | 2.117 | 0,13 |
| 2,945 % fällig am 25.09.2035 | 1.500 | 1.331 | 0,08 |
| **Accunia European CLO BV** | | | |
| 0,950 % fällig am 15.07.2030 | € 2.800 | 3.195 | 0,20 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.07.2036 | $ 138 | 113 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | 1.200 | 580 | 0,04 |
| 3,019 % fällig am 25.12.2035 | 2.800 | 2.678 | 0,17 |
| **Adagio CLO Ltd.** | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2029 | € 900 | 1.029 | 0,07 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,874 % fällig am 25.11.2035 | $ 3.600 | 3.576 | 0,23 |
| 3,424 % fällig am 25.09.2034 | 3.500 | 3.515 | 0,22 |
| **Apex Credit CLO Ltd.** | | | |
| 3,632 % fällig am 27.10.2028 | 3.800 | 3.805 | 0,24 |
| **Apidos CLO** | | | |
| 3,572 % fällig am 19.01.2025 | 41 | 41 | 0,00 |
| **Argent Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,884 % fällig am 25.05.2035 | 126 | 122 | 0,01 |
| **Argent Securities Trust** | | | |
| 2,514 % fällig am 25.05.2036 | 193 | 72 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | 165 | 144 | 0,01 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 4,279 % fällig am 25.04.2034 | 613 | 628 | 0,04 |
| **Atrium Corp.** | | | |
| 3,422 % fällig am 22.04.2027 | 1.000 | 997 | 0,06 |
| **Aurium CLO DAC** | | | |
| 0,680 % fällig am 13.10.2029 | € 1.500 | 1.704 | 0,11 |
| **Avery Point CLO Ltd.** | | | |
| 3,721 % fällig am 18.01.2025 | $ 84 | 84 | 0,01 |
| **Babson Euro CLO BV** | | | |
| 0,509 % fällig am 25.10.2029 | € 3.000 | 3.403 | 0,22 |
| **Barings Euro CLO BV** | | | |
| 0,680 % fällig am 27.07.2030 | 500 | 568 | 0,04 |
| **Bayview Financial Acquisition Trust** | | | |
| 6,096 % fällig am 28.12.2036 | $ 2.278 | 2.313 | 0,15 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,594 % fällig am 25.05.2037 | 36 | 36 | 0,00 |
| 2,634 % fällig am 25.02.2037 | 2.824 | 2.577 | 0,16 |
| 2,894 % fällig am 25.07.2035 | 4 | 4 | 0,00 |
| 3,034 % fällig am 25.02.2036 | 3.500 | 3.498 | 0,22 |
| 3,084 % fällig am 25.10.2035 | 876 | 868 | 0,06 |
| 3,454 % fällig am 25.08.2037 | 1.313 | 1.160 | 0,07 |
| **Benefit Street Partners CLO Ltd.** | | | |
| 3,381 % fällig am 18.07.2027 | 1.100 | 1.093 | 0,07 |
| **Black Diamond CLO Designated Activity Co.** | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € 2.100 | 2.394 | 0,15 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | |
| 0,850 % fällig am 15.04.2027 | 629 | 716 | 0,05 |
| **Brookside Mill CLO Ltd.** | | | |
| 3,408 % fällig am 17.01.2028 | $ 1.250 | 1.244 | 0,08 |
| **Business Jet Securities LLC** | | | |
| 4,447 % fällig am 15.06.2033 | 817 | 830 | 0,05 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | |
| 3,432 % fällig am 27.01.2028 | 1.900 | 1.892 | 0,12 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | |
| 3,377 % fällig am 15.04.2027 | 2.500 | 2.499 | 0,16 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,464 % fällig am 25.07.2045 | 581 | 456 | 0,03 |
| 2,554 % fällig am 25.12.2036 | 131 | 68 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 25.05.2036 | 1.270 | 948 | 0,06 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 3,349 % fällig am 25.10.2034 | 100 | 100 | 0,01 |
| **Columbia Cent CLO Ltd.** | | | |
| 3,730 % fällig am 25.10.2028 | 3.700 | 3.697 | 0,24 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.09.2046 ^ | $ 47 | $ 46 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.11.2047 ^ | 513 | 462 | 0,03 |
| 2,604 % fällig am 25.06.2047 ^ | 4.184 | 3.736 | 0,24 |
| 2,614 % fällig am 25.05.2047 ^ | 118 | 100 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2037 ^ | 920 | 770 | 0,05 |
| 2,744 % fällig am 25.04.2036 | 14 | 14 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.08.2035 | 183 | 184 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 2,594 % fällig am 25.06.2047 | 28 | 28 | 0,00 |
| 2,884 % fällig am 25.05.2036 | 3.000 | 2.953 | 0,19 |
| 3,064 % fällig am 25.08.2035 | 700 | 697 | 0,04 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | |
| 3,319 % fällig am 25.01.2034 | 772 | 778 | 0,05 |
| 3,426 % fällig am 25.12.2036 ^ | 219 | 202 | 0,01 |
| **Crown Point CLO Ltd.** | | | |
| 3,762 % fällig am 20.10.2028 | 3.900 | 3.892 | 0,25 |
| **CVC Cordatus Loan Fund Ltd.** | | | |
| 0,970 % fällig am 22.04.2030 | € 2.200 | 2.516 | 0,16 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | 1.600 | 1.824 | 0,12 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | |
| 0,718 % fällig am 17.05.2027 | 1.746 | 1.990 | 0,13 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | |
| 3,497 % fällig am 15.10.2027 | $ 800 | 799 | 0,05 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | € 1.300 | 1.481 | 0,09 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | |
| 2,744 % fällig am 25.04.2047 | $ 3.099 | 2.372 | 0,15 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 2,530 % fällig am 25.08.2036 | 254 | 110 | 0,01 |
| 2,539 % fällig am 25.10.2036 | 231 | 218 | 0,01 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | |
| 5,772 % fällig am 25.11.2036 ^ | 627 | 334 | 0,02 |
| 5,985 % fällig am 25.06.2036 | 1.692 | 782 | 0,05 |
| **Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.** | | | |
| 3,512 % fällig am 20.04.2027 | 750 | 748 | 0,05 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | |
| 2,924 % fällig am 25.01.2036 | 2.200 | 2.039 | 0,13 |
| **Jamestown CLO Ltd.** | | | |
| 3,287 % fällig am 15.07.2026 | 462 | 462 | 0,03 |
| 3,410 % fällig am 25.07.2027 | 700 | 699 | 0,04 |
| 3,467 % fällig am 15.01.2028 | 900 | 897 | 0,06 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.07.2036 | 25 | 25 | 0,00 |
| **Jubilee CLO BV** | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | € 3.300 | 3.749 | 0,24 |
| 0,530 % fällig am 12.07.2028 | 5.600 | 6.377 | 0,41 |
| **LCM LP** | | | |
| 3,632 % fällig am 20.10.2027 | $ 1.000 | 1.000 | 0,06 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.02.2036 | 856 | 839 | 0,05 |
| 3,319 % fällig am 25.08.2035 | 4.270 | 4.011 | 0,26 |
| **Marathon CLO Ltd.** | | | |
| 3,392 % fällig am 21.11.2027 | 1.000 | 996 | 0,06 |
| **Monarch Grove CLO** | | | |
| 3,460 % fällig am 25.01.2028 | 2.400 | 2.390 | 0,15 |
| **Monroe Capital BSL CLO Ltd.** | | | |
| 3,643 % fällig am 22.05.2027 | 200 | 200 | 0,01 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,474 % fällig am 25.10.2036 | 1.880 | 1.151 | 0,07 |
| 2,529 % fällig am 25.07.2036 | 694 | 608 | 0,04 |
| 2,544 % fällig am 25.05.2037 | 2.269 | 2.038 | 0,13 |
| 2,634 % fällig am 25.10.2036 | 1.542 | 984 | 0,06 |
| 2,634 % fällig am 25.11.2036 | 7.283 | 5.299 | 0,34 |
| 2,654 % fällig am 25.04.2036 | 165 | 158 | 0,01 |
| 2,944 % fällig am 25.12.2034 | 1.362 | 1.365 | 0,09 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,744 % fällig am 25.02.2036 | 1.800 | 1.725 | 0,11 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 5,726 % fällig am 25.10.2036 ^ | 364 | 183 | 0,01 |
| **Mountain View CLO Ltd.** | | | |
| 3,417 % fällig am 13.10.2027 | 1.700 | 1.694 | 0,11 |
| **Newhaven CLO DAC** | | | |
| 0,990 % fällig am 15.02.2030 | € 700 | 799 | 0,05 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,804 % fällig am 25.02.2037 ^ | $ 3.775 | 1.524 | 0,10 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.09.2037 | $ 82 | $ 81 | 0,01 |
| 2,724 % fällig am 25.05.2036 | 129 | 128 | 0,01 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | 1.500 | 1.497 | 0,10 |
| 3,406 % fällig am 26.10.2027 | 1.300 | 1.298 | 0,08 |
| 3,438 % fällig am 17.04.2027 | 900 | 899 | 0,06 |
| **OFSI Fund Ltd.** | | | |
| 3,247 % fällig am 20.03.2025 | 358 | 358 | 0,02 |
| 3,501 % fällig am 18.10.2026 | 128 | 128 | 0,01 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 | 71 | 47 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.02.2037 | 881 | 647 | 0,04 |
| 2,544 % fällig am 25.03.2037 | 1.218 | 1.116 | 0,07 |
| 2,624 % fällig am 25.04.2037 | 860 | 702 | 0,04 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | 930 | 645 | 0,04 |
| **Orwell Park CLO Designated Activity Co.** | | | |
| 0,780 % fällig am 18.07.2029 | € 400 | 456 | 0,03 |
| **OZLM Ltd.** | | | |
| 3,663 % fällig am 30.07.2027 | $ 1.700 | 1.699 | 0,11 |
| **Palmer Square Loan Funding Ltd.** | | | |
| 3,418 % fällig am 15.11.2026 | 2.479 | 2.477 | 0,16 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,734 % fällig am 25.07.2036 | 1.000 | 948 | 0,06 |
| **RAAC Trust** | | | |
| 2,784 % fällig am 25.10.2046 | 170 | 168 | 0,01 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.11.2036 | 101 | 89 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.04.2037 | 43 | 43 | 0,00 |
| 2,814 % fällig am 25.01.2036 | 51 | 51 | 0,00 |
| **RMAT LP** | | | |
| 4,090 % fällig am 25.05.2048 | 1.178 | 1.188 | 0,08 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | |
| 3,064 % fällig am 25.08.2035 ^ | 105 | 72 | 0,00 |
| **SG Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,614 % fällig am 25.10.2036 | 3.600 | 2.959 | 0,19 |
| **Sierra Madre Funding Ltd.** | | | |
| 2,799 % fällig am 07.09.2039 | 4.508 | 4.068 | 0,26 |
| **SoFi Consumer Loan Program LLC** | | | |
| 2,770 % fällig am 25.05.2026 | 83 | 83 | 0,01 |
| **SoFi Consumer Loan Program Trust** | | | |
| 2,550 % fällig am 25.02.2027 | 184 | 184 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 2,604 % fällig am 25.06.2037 | 3.295 | 2.468 | 0,16 |
| 2,654 % fällig am 25.10.2036 | 600 | 579 | 0,04 |
| 2,664 % fällig am 25.02.2037 | 1.164 | 459 | 0,03 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 3,379 % fällig am 25.01.2035 | 1.685 | 1.650 | 0,11 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,940 % fällig am 25.04.2035 | 98 | 97 | 0,01 |
| **THL Credit Wind River CLO Ltd.** | | | |
| 3,467 % fällig am 15.10.2027 | 700 | 699 | 0,04 |
| **TICP CLO Ltd.** | | | |
| 3,392 % fällig am 20.07.2027 | 1.500 | 1.495 | 0,10 |
| **Tikehau CLO BV** | | | |
| 0,880 % fällig am 07.12.2029 (b) | € 3.000 | 3.416 | 0,22 |
| **Tralee CLO Ltd.** | | | |
| 3,622 % fällig am 20.10.2027 | $ 900 | 900 | 0,06 |
| 3,702 % fällig am 20.10.2028 | 2.400 | 2.394 | 0,15 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | |
| 3,417 % fällig am 15.04.2027 | 1.250 | 1.248 | 0,08 |
| 3,447 % fällig am 15.01.2028 | 700 | 698 | 0,04 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | 592 | 595 | 0,04 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | |
| 3,300 % fällig am 25.07.2026 | 1.058 | 1.057 | 0,07 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | |
| 2,629 % fällig am 25.05.2037 | 860 | 829 | 0,05 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,129 % fällig am 25.11.2035 | 100 | 101 | 0,01 |
| **Z Capital Credit Partners CLO Ltd.** | | | |
| 3,551 % fällig am 16.07.2027 | 1.800 | 1.797 | 0,11 |
| | | 166.856 | 10,64 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Argentina Government International Bond | | | | |
| 5,875 % fällig am 11.01.2028 | $ | 3.500 | $ 2.671 | 0,17 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | ARS | 7.790 | 158 | 0,01 |
| 53,892 % fällig am 01.03.2020 (a) | | 200 | 5 | 0,00 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 50.181 | 1.156 | 0,07 |
| Autonomous Community of Catalonia | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | € | 850 | 1.048 | 0,07 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 300 | 351 | 0,02 |
| Peru Government International Bond | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 34.232 | 11.363 | 0,72 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 11.700 | 3.915 | 0,25 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 5.746 | 1.963 | 0,12 |
| Qatar Government International Bond | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 1.000 | 1.050 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 23.04.2028 | | 1.200 | 1.345 | 0,09 |
| Saudi Government International Bond | | | | |
| 3,250 % fällig am 26.10.2026 | | 100 | 102 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 04.03.2028 | | 1.600 | 1.646 | 0,10 |
| 4,500 % fällig am 17.04.2030 | | 5.700 | 6.228 | 0,40 |
| | | | 33.001 | 2,10 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g) | 385.356 | 4.085 | 0,26 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Nationwide Building Society | | | |
| 10,250 % | 1.500 | 289 | 0,02 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (g) | 614.500 | $ 62.365 | 3,98 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | | |
| Bank of Montreal | | | | |
| 1,804 % fällig am 08.07.2019 | CAD | 16.200 | 12.392 | 0,79 |
| Bank of Nova Scotia | | | | |
| 1,785 % fällig am 22.07.2019 | | 9.100 | 6.956 | 0,44 |
| Boston Scientific Corp. | | | | |
| 2,910 % fällig am 10.07.2019 | $ | 3.700 | 3.697 | 0,24 |
| Broadcom, Inc. | | | | |
| 2,910 % fällig am 09.07.2019 | | 4.700 | 4.696 | 0,30 |
| C.I.B.C. | | | | |
| 1,819 % fällig am 17.07.2019 | CAD | 6.200 | 4.740 | 0,30 |
| Crown Castle International Corp. | | | | |
| 2,800 % fällig am 17.07.2019 | $ | 4.200 | 4.194 | 0,27 |
| Enable Midstream Partners LP | | | | |
| 3,150 % fällig am 25.07.2019 | | 1.900 | 1.896 | 0,12 |
| Enbridge, Inc. | | | | |
| 2,830 % fällig am 06.08.2019 | | 6.500 | 6.482 | 0,41 |
| Encana Corp. | | | | |
| 3,200 % fällig am 06.08.2019 | | 6.400 | 6.382 | 0,41 |
| Energy Transfer Partners LP | | | | |
| 3,030 % fällig am 02.07.2019 | | 7.000 | 6.998 | 0,45 |
| Royal Bank of Canada | | | | |
| 1,777 % fällig am 25.07.2019 | CAD | 4.500 | 3.439 | 0,22 |
| 1,795 % fällig am 31.07.2019 | | 19.600 | 14.976 | 0,95 |
| Royal Caribbean Cruise | | | | |
| 2,900 % fällig am 15.07.2019 | $ | 2.900 | $ 2.897 | 0,18 |
| 2,970 % fällig am 01.07.2019 | | 2.600 | 2.600 | 0,17 |
| Toronto-Dominion Bank | | | | |
| 1,787 % fällig am 22.07.2019 | CAD | 8.600 | 6.574 | 0,42 |
| 1,792 % fällig am 16.07.2019 | | 1.800 | 1.376 | 0,09 |
| 1,795 % fällig am 19.07.2019 | | 7.800 | 5.963 | 0,38 |
| VW Credit, Inc. | | | | |
| 2,900 % fällig am 09.07.2019 | $ | 6.300 | 6.295 | 0,40 |
| | | | 102.553 | 6,54 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (i)** | | | 3.818 | 0,24 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 106.371 | 6,78 |

| | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g) | 3.377 | 33.823 | 2,16 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 1.637.330** | **104,39** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09/2019 | 106 | $ (69) | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2019 | 735 | (4.256) | (0,27) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 12 | (24) | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1.258 | 1.905 | 0,12 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 181 | 499 | 0,03 |
| | | | | $ (1.945) | (0,12) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (1.945)** | **(0,12)** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| AT&T, Inc. | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 5.100 | $ 24 | 0,00 |
| Daimler AG | 1,000 | 20.12.2020 | € 1.000 | (2) | 0,00 |
| Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2019 | 1.200 | 0 | 0,00 |
| Enbridge, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 50 | 1 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2024 | € 3.200 | 6 | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2024 | 3.200 | 24 | 0,00 |
| | | | | $ 53 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Main 28 5-Year Index | (1,000) % | 20.12.2022 | € 350 | $ 1 | 0,00 |
| iTraxx Europe Senior 27 5-Year Index | (1,000) | 20.06.2022 | 100 | 1 | 0,00 |
| iTraxx Europe Subordinated 27 5-Year Index | (1,000) | 20.06.2022 | 2.300 | (7) | 0,00 |
| | | | | $ (5) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-30 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 35.900 | $ 360 | 0,02 |
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 8.800 | 83 | 0,01 |
| CDX.HY-32 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2024 | 21.200 | 623 | 0,04 |
| CDX.IG-31 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2023 | 9.300 | 134 | 0,01 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 47.300 | 149 | 0,01 |
| | | | | $ 1.349 | 0,09 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 21.06.2027 | $ 1.400 | $ (59) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 21.12.2026 | 100 | (4) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 27.06.2024 | 38.900 | (354) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 20.12.2019 | 100 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 39.540 | (3.442) | (0,22) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 21.12.2046 | 2.195 | (278) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.12.2027 | 40.160 | (2.286) | (0,15) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 23.740 | (3.815) | (0,24) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,700 | 14.12.2023 | 1.200 | 62 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 800 | (60) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 30.000 | (631) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 36.300 | (7.057) | (0,45) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2024 | € 19.200 | 92 | 0,01 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | 34.020 | 762 | 0,05 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.12.2049 | 3.600 | (25) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | 7.710 | (1.202) | (0,08) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2024 | £ 22.300 | (25) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | 142.900 | (3.159) | (0,20) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 18.03.2026 | ¥ 5.150.000 | (820) | (0,05) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 20.03.2028 | 1.760.000 | (525) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 20.03.2029 | 3.250.000 | (554) | (0,04) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,350 | 30.09.2027 | MXN 99.500 | 82 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 3,596 | 15.05.2034 | £ 6.500 | (66) | (0,01) |
| Erhalt | UKRPI | 3,579 | 15.10.2033 | 4.900 | 57 | 0,00 |
| | | | | | $ (23.307) | (1,49) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | $ (21.910) | **(1,40)** |

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

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,945 % | 11.12.2019 | 4.800 | $ 227 | $ 9 | 0,00 |
| GLM | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,943 | 12.12.2019 | 2.400 | 115 | 5 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,945 | 11.12.2019 | 2.100 | 185 | 4 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 527 | $ 18 | 0,00 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 % | 18.09.2019 | 2.800 | $ (4) | $ (1) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 4.100 | (6) | (1) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 3.800 | (6) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 7.000 | (14) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 7.200 | (15) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 9.400 | (15) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | $ (60) | $ (7) | 0,00 |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 % | 11.12.2019 | 21.200 | $ (227) | $ (2) | 0,00 |
| GLM | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 12.12.2019 | 10.600 | (116) | (1) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 11.12.2019 | 8.100 | (195) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (538) | $ (4) | 0,00 |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | UBS AG | (1,000) % | 20.06.2024 | $ 200 | $ 13 | $ (16) | $ (3) | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 % | 20.12.2022 | $ 400 | $ 47 | $ (103) | $ (56) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 200 | (1) | 4 | 3 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (3) | 3 | 0 | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 200 | (26) | 1 | (25) | 0,00 |
| BPS | Intesa Sanpaolo SpA | 1,000 | 20.06.2023 | € 800 | (112) | 59 | (53) | 0,00 |
| BRC | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | $ 100 | (3) | 4 | 1 | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 6.200 | (812) | 28 | (784) | (0,05) |
| CBK | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 100 | (1) | 1 | 0 | 0,00 |
| GLM | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2023 | 1.200 | (88) | 57 | (31) | 0,00 |
| GST | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2022 | 200 | 18 | (45) | (27) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 200 | (7) | 2 | (5) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (3) | 5 | 2 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 3.500 | (56) | 34 | (22) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 2.300 | (102) | 31 | (71) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 700 | (101) | 12 | (89) | (0,01) |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 400 | (12) | 3 | (9) | 0,00 |
| MYC | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 500 | (16) | 15 | (1) | 0,00 |
| MYI | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 600 | (87) | 11 | (76) | (0,01) |
| | | | | | $ (1.365) | $ 122 | $ (1.243) | (0,08) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17.11.2059 | $ 2.200 | $ (9) | $ 27 | $ 18 | 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) | 15 | 12 | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 300 | (10) | 12 | 2 | 0,00 |
| | | | | | $ (26) | $ 59 | $ 33 | 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.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Libor Plus Bond Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | DKK | 79.969 | $ | 12.216 | $ 14 | $ 0 | $ 14 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 1.727 | | 2.194 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 15.241 | AUD | 21.825 | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5.574 | CAD | 7.332 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 224.144 | € | 197.241 | 474 | 0 | 474 | 0,03 |
| | 08/2019 | AUD | 21.825 | $ | 15.257 | 0 | (75) | (75) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 7.332 | | 5.578 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 197.241 | | 224.715 | 0 | (477) | (477) | (0,03) |
| | 09/2019 | SGD | 7.081 | | 5.173 | 0 | (67) | (67) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 28.521 | | 909 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | CAD | 34.600 | | 26.392 | 0 | (102) | (102) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 1.946 | | 2.183 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 221 | ARS | 11.046 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 70.408 | £ | 55.511 | 241 | 0 | 241 | 0,02 |
| | 08/2019 | £ | 55.511 | $ | 70.515 | 0 | (243) | (243) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ | 6.327 | ARS | 282.359 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 08/2019 | | 26 | MXN | 515 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 79.969 | $ | 12.278 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 2.875 | | 854 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € | 6.835 | | 7.695 | 0 | (88) | (88) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 3.175 | € | 2.808 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 21.825 | $ | 15.109 | 0 | (207) | (207) | (0,01) |
| | 07/2019 | CAD | 8.600 | | 6.525 | 0 | (59) | (59) | 0,00 |
| | 07/2019 | COP | 19.968.340 | | 6.269 | 52 | 0 | 52 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 5.194 | | 5.895 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 800.820 | | 7.351 | 0 | (82) | (82) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 5.901 | COP | 19.968.340 | 318 | 0 | 318 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 1.834 | £ | 1.447 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 515 | $ | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 6.241 | COP | 19.968.340 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | £ | 1.379 | $ | 1.756 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.379 | ARS | 111.945 | 231 | 0 | 231 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 6.352 | € | 5.600 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.429 | RUB | 161.314 | 123 | 0 | 123 | 0,01 |
| | 08/2019 | RUB | 166.276 | $ | 2.525 | 0 | (89) | (89) | (0,01 |
| HUS | 07/2019 | ARS | 111.945 | | 2.311 | 0 | (299) | (299) | (0,02 |
| | 07/2019 | CAD | 18.032 | | 13.529 | 0 | (274) | (274) | (0,02 |
| | 07/2019 | € | 1.320 | | 1.502 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 3.330 | | 4.235 | 4 | (7) ) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 501 | ARS | 24.976 | 65 | 0 | 65 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.660 | £ | 2.100 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 766 | MXN | 15.000 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 91.643 | $ | 2.927 | 0 | (50 | (50) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CAD | 24.000 | | 18.128 | 0 | (242) | (242) | (0,02) |
| | 07/2019 | £ | 1.067 | | 1.358 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 08/2019 | MXN | 158.484 | | 7.980 | 0 | (212) | (212) | (0,01) |
| RYL | 07/2019 | CAD | 1.800 | | 1.366 | 0 | (12 | (12) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 52.742 | | 66.755 | 0 | (369) | (369) | (0,02) |
| | 11/2019 | TWD | 36.459 | | 1.165 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € | 195.012 | | 217.784 | 0 | (4.297) | (4.297) | (0,27) |
| | 07/2019 | ¥ | 87.600 | | 811 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | $ | 8.254 | ¥ | 888.420 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 888.420 | $ | 8.274 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.742 | $ (7.487) | $ (5.745) | (0,36) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 32.614 | $ | 37.062 | $ 0 | $ (78) | $ (78) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 37.157 | € | 32.614 | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | € | 30.882 | $ | 35.111 | 0 | (58) | (58) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 24.062 | € | 21.372 | 276 | 0 | 276 | 0,02 |
| | 08/2019 | | 35.051 | | 30.749 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | | 22.389 | | 20.019 | 409 | 0 | 409 | 0,03 |
| CBK | 07/2019 | € | 32.614 | $ | 37.065 | 0 | (75) | (75) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.275 | € | 2.002 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 37.160 | | 32.614 | 75 | 0 | 75 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 13.653 | | 12.168 | 204 | 0 | 204 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | | 20.687 | | 18.501 | 381 | 0 | 381 | 0,02 |
| RBC | 07/2019 | € | 43 | $ | 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | $ | 81 | € | 72 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 619 | | 550 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 3.274 | | 2.924 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 22.386 | | 20.019 | 412 | 0 | 412 | 0,03 |
| | | | | | | $ 1.961 | $ (211) | $ 1.750 | 0,11 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | $ 18.868 | £ 14.862 | $ 47 | $ 0 | $ 47 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 349.778 | $ 443.642 | 0 | (1.520) | (1.520) | (0,11) |
| | 07/2019 | $ 12.445 | £ 9.814 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | 08/2019 | 444.321 | 349.778 | 1.533 | 0 | 1.533 | 0,10 |
| CBK | 07/2019 | £ 348.609 | $ 442.941 | 0 | (733) | (733) | (0,05) |
| | 07/2019 | $ 428.023 | £ 337.812 | 1.910 | 0 | 1.910 | 0,12 |
| | 08/2019 | 443.620 | 348.609 | 745 | 0 | 745 | 0,05 |
| GLM | 07/2019 | £ 2.922 | $ 3.712 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 1.444 | £ 1.142 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 2.531 | 1.985 | 2 | (7) | (5) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 333 | 261 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 434.448 | 343.278 | 2.442 | 0 | 2.442 | 0,16 |
| SSB | 07/2019 | 425.826 | 336.999 | 3.073 | (1) | 3.072 | 0,21 |
| UAG | 07/2019 | 11.061 | 8.675 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | | | | $ 9.807 | $ (2.290) | $ 7.517 | 0,48 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 2.316** | **0,15** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **$ 1.615.791** | **103,02** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **$ (47.373)** | **(3,02)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **$ 1.568.418** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(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.**

**Barmittel in Höhe von USD 24.238 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 3.490 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(i) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 3.818 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (3.898) | $ 3.818 | $ 3.819 | 0,24 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (3.898)** | **$ 3.818** | **$ 3.819** | **0,24** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 100.273 | $ 1.537.057 | $ 0 | $ 1.637.330 |
| Finanzderivate[3] | (1.945) | (19.594) | 0 | (21.539) |
| **Summen** | **$ 98.328** | **$ 1.517.463** | **$ 0** | **$ 1.615.791** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 89.847 | $ 1.176.204 | $ 1.960 | $ 1.268.011 |
| Finanzderivate[3] | 752 | (10.069) | 0 | (9.317) |
| **Summen** | **$ 90.599** | **$ 1.166.135** | **$ 1.960** | **$ 1.258.694** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (105) | $ 0 | $ (105) |
| BPS | 132 | (650) | (518) |
| BRC | (441) | 520 | 79 |
| CBK | 1.883 | (470) | 1.413 |
| CKL | (1) | 0 | (1) |
| GLM | 471 | (430) | 41 |
| GST | (199) | 260 | 61 |
| HUS | (561) | 0 | (561) |
| MYC | 3 | 0 | 3 |
| MYI | 62 | 0 | 62 |
| RBC | (212) | 0 | (212) |
| RYL | (11) | 0 | (11) |
| SAL | 12 | 0 | 12 |
| SCX | 2.061 | (820) | 1.241 |
| SSB | (1.171) | 2.710 | 1.539 |
| TOR | 412 | (430) | (18) |
| UAG | (19) | 0 | (19) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 68,02 | 60,65 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 36,13 | 58,27 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,24 | 3,07 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,12) | 0,07 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,40) | (0,54) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,15 | (0,43) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 0,42 | 1,06 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 32,68 | 28,29 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,02 | 0,03 |
| US-Regierungsbehörden | 16,22 | 24,66 |
| US-Schatzobligationen | 24,63 | 29,95 |
| Non-Agency-MBS | 4,48 | 2,98 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 10,64 | 13,15 |
| Staatsemissionen | 2,10 | 1,45 |
| Investmentfonds | 0,26 | 0,00 |
| Vorzugswertpapiere | 0,02 | 0,03 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 3,98 | 5,97 |
| Kurzfristige Instrumente | 6,78 | 11,74 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 2,16 | 2,68 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,12) | 0,07 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,09 | (0,07) |
| Zinsswaps | (1,49) | (0,48) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoption | 0,00 | 0,04 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Zinsswapoption | 0,00 | (0,04) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,08) | (0,05) |
| Devisenterminkontrakte | (0,36) | (0,18) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,59 | (0,20) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (3,02) | (21,09) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | ARS | 3.140 | $ 64 | 0,01 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 68.945 | 1.588 | 0,14 |
| Summe Argentinien | | | 1.652 | 0,15 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Driver Australia Four Trust** | | | | |
| 2,185 % fällig am 21.08.2025 | AUD | 1.700 | 1.193 | 0,11 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027 | | 6.003 | 4.498 | 0,40 |
| 1,250 % fällig am 21.02.2022 | | 8.827 | 6.434 | 0,57 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2025 | | 5.457 | 4.576 | 0,41 |
| | | | 15.508 | 1,38 |
| Summe Australien | | | 16.701 | 1,49 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | $ | 124 | 133 | 0,01 |
| 6,625 % fällig am 16.01.2034 | £ | 100 | 142 | 0,01 |
| Summe Brasilien | | | 275 | 0,02 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | $ | 1.900 | 1.900 | 0,17 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.03.2021 | | 1.200 | 1.204 | 0,11 |
| | | | 3.104 | 0,28 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.12.2050 (b) | CAD | 837 | 677 | 0,06 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026 (b) | | 7.741 | 7.752 | 0,69 |
| | | | 8.429 | 0,75 |
| Summe Kanada | | | 11.533 | 1,03 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **CVP Cascade CLO Ltd.** | | | | |
| 3,751 % fällig am 16.01.2026 | $ | 386 | 386 | 0,03 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | | 640 | 639 | 0,06 |
| | | | 1.025 | 0,09 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 200 | 212 | 0,02 |
| Summe Cayman Inseln | | | 1.237 | 0,11 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 6.900 | 1.039 | 0,09 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 23.800 | 3.688 | 0,33 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 36 | 6 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 18.100 | 2.726 | 0,24 |
| 2,000 % fällig am 01.04.2020 | | 36.600 | 5.707 | 0,51 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 97 | 15 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 31.700 | 4.774 | 0,43 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 135.500 | 20.995 | 1,88 |
| 2,000 % fällig am 01.04.2020 | DKK | 34.900 | $ 5.429 | 0,49 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 13 | 2 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | | 70 | 11 | 0,00 |
| | | | 44.392 | 3,97 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Denmark Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (b) | | 11.702 | 1.924 | 0,17 |
| Summe Dänemark | | | 46.316 | 4,14 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Danone S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2022 | $ | 600 | 611 | 0,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 25.07.2021 (b) | € | 22.841 | 26.791 | 2,39 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 (b) | | 9.038 | 10.993 | 0,98 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2036 (b) | | 206 | 263 | 0,02 |
| 1,100 % fällig am 25.07.2022 (b) | | 33.378 | 41.009 | 3,66 |
| 1,300 % fällig am 25.07.2019 (b) | | 28.698 | 32.745 | 2,93 |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 (b) | | 1.318 | 2.281 | 0,21 |
| 2,100 % fällig am 25.07.2023 (b) | | 31.455 | 40.883 | 3,65 |
| 2,250 % fällig am 25.07.2020 (b) | | 10.341 | 12.213 | 1,09 |
| | | | 167.178 | 14,93 |
| Summe Frankreich | | | 167.789 | 14,99 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | $ | 3.100 | 3.144 | 0,28 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 600 | 622 | 0,06 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 23.12.2019 | | 2.400 | 2.415 | 0,22 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ONGC Videsh Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.07.2019 | | 600 | 600 | 0,05 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 3,539 % fällig am 06.04.2020 | | 4.800 | 4.812 | 0,43 |
| Summe Indien | | | 5.412 | 0,48 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Arbour CLO DAC** | | | | |
| 0,580 % fällig am 15.03.2029 | € | 3.300 | 3.747 | 0,34 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 26.04.2029 | | 1.700 | 1.938 | 0,17 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 21.09.2029 | | 700 | 798 | 0,07 |
| **Cork Street CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,590 % fällig am 27.11.2028 | | 1.000 | 1.144 | 0,10 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | | 500 | 570 | 0,05 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | | 5.500 | 6.264 | 0,56 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 4.220 | 4.806 | 0,43 |
| **Orwell Park CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,780 % fällig am 18.07.2029 | | 100 | 114 | 0,01 |
| **Tymon Park CLO Ltd.** | | | | |
| 0,590 % fällig am 21.01.2029 | | 900 | 1.023 | 0,09 |
| | | | 20.404 | 1,82 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Shire Acquisitions Investments Ireland DAC** | | | | |
| 1,900 % fällig am 23.09.2019 | € | 2.200 | $ 2.197 | 0,19 |
| Summe Irland | | | 22.601 | 2,01 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | | 800 | 842 | 0,08 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 4.900 | 5.601 | 0,50 |
| | | | 6.443 | 0,58 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 1,650 % fällig am 23.04.2020 (b) | € | 2.006 | 2.314 | 0,20 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (b) | | 29.082 | 35.708 | 3,19 |
| 2,600 % fällig am 15.09.2023 (b) | | 24.367 | 30.102 | 2,69 |
| | | | 68.124 | 6,08 |
| Summe Italien | | | 74.567 | 6,66 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 2,567 % fällig am 02.11.2021 | $ | 5.900 | 5.922 | 0,53 |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | | 7.300 | 7.312 | 0,65 |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 2,701 % fällig am 16.03.2020 | | 500 | 500 | 0,05 |
| | | | 13.734 | 1,23 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (b) | ¥ | 1.437.130 | 13.932 | 1,24 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2029 (b) | | 388.146 | 3.763 | 0,34 |
| | | | 17.695 | 1,58 |
| Summe Japan | | | 31.429 | 2,81 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Allergan Funding SCS** | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.03.2020 | $ | 1.600 | 1.605 | 0,14 |
| 3,691 % fällig am 12.03.2020 | | 700 | 705 | 0,06 |
| | | | 2.310 | 0,20 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Delos Finance SARL** | | | | |
| 4,080 % fällig am 06.10.2023 | | 83 | 83 | 0,01 |
| Summe Luxemburg | | | 2.393 | 0,21 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Barings Euro CLO BV** | | | | |
| 0,680 % fällig am 27.07.2030 | € | 700 | 795 | 0,07 |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 2.410 | 2.752 | 0,25 |
| 0,930 % fällig am 30.04.2031 | | 1.700 | 1.943 | 0,17 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | | 4.100 | 4.672 | 0,42 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | | 710 | 807 | 0,07 |
| **Penta CLO BV** | | | | |
| 0,790 % fällig am 04.08.2028 | | 1.900 | 2.166 | 0,19 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,600 % fällig am 04.08.2028 | | 3.700 | 4.209 | 0,38 |
| | | | 17.344 | 1,55 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (c)(e) | | 1.000 | 1.187 | 0,11 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (c)(e) | | 800 | 1.011 | 0,09 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | $ | 700 | $ 714 | 0,06 |
| | | | 2.912 | 0,26 |
| Summe Niederlande | | | 20.256 | 1,81 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | NZD | 1.277 | 938 | 0,08 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 4.900 | 1.626 | 0,14 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 16.600 | 5.555 | 0,50 |
| Summe Peru | | | 7.181 | 0,64 |
| **QATAR** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **State Of Qatar** | | | | |
| 2,983 % fällig am 21.12.2020 | $ | 10.000 | 9.975 | 0,89 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | | 1.700 | 1.785 | 0,16 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 1.300 | 1.552 | 0,14 |
| | | | 3.337 | 0,30 |
| Summe Katar | | | 13.312 | 1,19 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (c)(e) | € | 200 | 236 | 0,02 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (c)(e) | | 200 | 235 | 0,02 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (c)(e) | | 300 | 360 | 0,04 |
| | | | 831 | 0,08 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | | 1.100 | 1.355 | 0,12 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 2.000 | 2.343 | 0,21 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 0,550 % fällig am 30.11.2019 (b) | | 32.268 | 36.952 | 3,30 |
| 0,650 % fällig am 30.11.2027 (b) | | 8.133 | 10.314 | 0,92 |
| 1,400 % fällig am 30.07.2028 | | 15.700 | 19.613 | 1,75 |
| | | | 70.577 | 6,30 |
| Summe Spanien | | | 71.408 | 6,38 |
| **SWEDEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sweden Government International Bond** | | | | |
| 0,125 % fällig am 01.06.2026 | SEK | 41.340 | 5.189 | 0,46 |
| 1,000 % fällig am 01.06.2025 | | 18.605 | 2.407 | 0,22 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2020 | | 26.030 | 3.066 | 0,27 |
| Summe Schweden | | | 10.662 | 0,95 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **UBS AG** | | | | |
| 3,031 % fällig am 08.06.2020 | $ | 5.600 | 5.630 | 0,50 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 4,377 % fällig am 14.04.2021 | | 1.000 | 1.024 | 0,09 |
| Summe Schweiz | | | 6.654 | 0,59 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | | 3.500 | 3.509 | 0,32 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 0,869 % fällig am 13.09.2021 | € | 1.300 | 1.485 | 0,13 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,186 % fällig am 21.06.2021 | $ | 1.100 | $ 1.101 | 0,10 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | | 1.600 | 1.598 | 0,14 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 1.000 | 1.042 | 0,09 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (c)(e) | | 930 | 956 | 0,09 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (c)(e) | | 200 | 216 | 0,02 |
| | | | 9.907 | 0,89 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,911 % fällig am 18.03.2039 | £ | 84 | 105 | 0,01 |
| 0,931 % fällig am 18.06.2038 | | 369 | 461 | 0,04 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,971 % fällig am 15.07.2051 | | 1.077 | 1.379 | 0,12 |
| | | | 1.945 | 0,17 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2024 (b) | | 4.873 | 7.036 | 0,63 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2026 (b) | | 7.028 | 10.676 | 0,95 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2028 (b) | | 7.418 | 11.931 | 1,07 |
| 0,125 % fällig am 22.11.2056 (b) | | 37 | 95 | 0,01 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 (b) | | 11.876 | 20.444 | 1,83 |
| 1,875 % fällig am 22.11.2022 (b) | | 55.053 | 81.571 | 7,28 |
| 2,500 % fällig am 16.04.2020 | | 69.184 | 91.269 | 8,15 |
| | | | 223.022 | 19,92 |
| Summe Großbritannien | | | 234.874 | 20,98 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,304 % fällig am 25.10.2034 | $ | 1.720 | 1.725 | 0,15 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,569 % fällig am 25.03.2036 | | 443 | 443 | 0,04 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.02.2036 | | 93 | 93 | 0,01 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,229 % fällig am 25.01.2035 | | 15 | 15 | 0,00 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 3,139 % fällig am 25.07.2035 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.01.2036 | | 141 | 142 | 0,01 |
| **Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,844 % fällig am 25.11.2035 | | 952 | 956 | 0,09 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,944 % fällig am 25.03.2035 | | 3.151 | 3.009 | 0,27 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 3,354 % fällig am 25.10.2033 | | 1.193 | 1.205 | 0,11 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,614 % fällig am 25.01.2037 | | 1.698 | 1.676 | 0,15 |
| | | | 9.365 | 0,84 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 2.750 | 2.757 | 0,25 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 500 | 506 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 15.09.2020 | | 200 | 211 | 0,02 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | | 200 | 200 | 0,02 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2019 | | 5.100 | 5.124 | 0,46 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | | 2.200 | 2.212 | 0,20 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 3.700 | 3.734 | 0,33 |
| 5,150 % fällig am 15.02.2050 | | 1.400 | 1.548 | 0,14 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 2,297 % fällig am 14.08.2020 | | 600 | 599 | 0,05 |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | | 4.200 | 4.211 | 0,38 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,040 % fällig am 15.03.2021 | | 1.100 | 1.098 | 0,10 |
| **Consolidated Edison Co. of New York, Inc.** | | | | |
| 2,749 % fällig am 25.06.2021 | $ | 400 | $ 401 | 0,03 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.02.2020 | | 1.900 | 1.914 | 0,17 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 3,097 % fällig am 20.09.2019 | | 900 | 901 | 0,08 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 500 | 503 | 0,04 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | | 1.100 | 1.105 | 0,10 |
| **Duke Energy Corp.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 15.08.2022 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 3.000 | 2.984 | 0,27 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | € | 700 | 781 | 0,07 |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | | 2.200 | 2.478 | 0,22 |
| **GATX Corp.** | | | | |
| 3,285 % fällig am 05.11.2021 | $ | 5.500 | 5.478 | 0,49 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 2,350 % fällig am 04.10.2019 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,610 % fällig am 15.09.2020 | | 2.300 | 2.323 | 0,21 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 2.500 | 2.698 | 0,24 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 200 | 205 | 0,02 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 5,250 % fällig am 31.03.2020 | | 100 | 102 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | | 1.100 | 1.152 | 0,10 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 30.06.2021 | | 400 | 401 | 0,04 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 26.10.2020 | | 1.900 | 1.943 | 0,17 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 2.700 | 2.801 | 0,25 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | | 3.300 | 3.301 | 0,29 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.03.2023 | | 100 | 102 | 0,01 |
| **Oncor Electric Delivery Co. LLC** | | | | |
| 4,100 % fällig am 01.06.2022 | | 100 | 105 | 0,01 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.05.2020 | | 800 | 828 | 0,07 |
| **Ryder System, Inc.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 03.09.2019 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 200 | 223 | 0,02 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 500 | 538 | 0,05 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 200 | 208 | 0,02 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 21.08.2020 | | 2.500 | 2.494 | 0,22 |
| 3,900 % fällig am 21.08.2027 | | 300 | 305 | 0,03 |
| | | | 58.774 | 5,25 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 3,044 % fällig am 25.10.2028 | | 26 | 25 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,640 % fällig am 19.07.2035 | | 114 | 114 | 0,01 |
| 2,870 % fällig am 19.04.2035 | | 683 | 678 | 0,06 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,984 % fällig am 25.07.2045 | | 728 | 725 | 0,07 |
| 3,044 % fällig am 25.07.2045 | | 197 | 202 | 0,02 |
| | | | 1.744 | 0,16 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.03.2049 | | 5.689 | 5.676 | 0,51 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 172.770 | 176.603 | 15,77 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | | 45.400 | 46.912 | 4,19 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 2,783 % fällig am 20.02.2049 | | 5.722 | 5.718 | 0,51 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| 3,030 % fällig am 20.08.2068 | $ 2.311 | $ 2.268 | 0,20 |
| 3,167 % fällig am 20.08.2066 | 772 | 775 | 0,07 |
| | | 237.952 | 21,25 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (f) | 54.486 | 53.922 | 4,82 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2021 (f) | 172.012 | 170.450 | 15,22 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2022 (f) | 6.965 | 6.923 | 0,62 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 | 103.741 | 102.948 | 9,19 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2023 (f) | 68.356 | 67.989 | 6,07 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 | 9.774 | 9.712 | 0,87 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | 5.252 | 5.260 | 0,47 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 19.563 | 19.785 | 1,77 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | 18.531 | 18.666 | 1,67 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | 1.139 | 1.150 | 0,10 |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 | 608 | 612 | 0,05 |
| 0,625 % fällig am 15.04.2023 | 47.831 | 48.405 | 4,32 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | 136 | 138 | 0,01 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 (f) | 64.830 | 66.412 | 5,93 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 (f) | 17.630 | 18.376 | 1,64 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | 15.047 | 15.845 | 1,42 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | 410 | 430 | 0,04 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | 5.201 | 5.477 | 0,49 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049 | 1.868 | 1.978 | 0,18 |
| 1,750 % fällig am 15.01.2028 | $ 1.281 | $ 1.436 | 0,13 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 10.015 | 11.148 | 1,00 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 | 248 | 318 | 0,03 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | 1.412 | 1.821 | 0,16 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2027 | 418 | 483 | 0,04 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | 3.708 | 4.967 | 0,44 |
| | | 634.651 | 56,68 |
| Summe USA | | 942.486 | 84,18 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| **Broadcom, Inc.** | | | |
| 2,830 % fällig am 18.07.2019 | 250 | 250 | 0,02 |
| 2,910 % fällig am 09.07.2019 | 1.700 | 1.698 | 0,15 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | |
| 2,800 % fällig am 17.07.2019 | 500 | 499 | 0,05 |
| **Enable Midstream Partners LP** | | | |
| 3,150 % fällig am 25.07.2019 | 400 | 399 | 0,04 |
| **Encana Corp.** | | | |
| 3,120 % fällig am 08.07.2019 | 250 | 250 | 0,02 |
| 3,200 % fällig am 01.08.2019 | 450 | 449 | 0,04 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | |
| 3,040 % fällig am 08.07.2019 | 1.300 | 1.299 | 0,12 |
| **Royal Caribbean Cruise** | | | |
| 2,900 % fällig am 11.07.2019 | $ 250 | $ 250 | 0,02 |
| **Royal Caribbean Cruises Ltd.** | | | |
| 2,900 % fällig am 15.07.2019 | 250 | 250 | 0,02 |
| | | 5.344 | 0,48 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (g)** | | | |
| | | 1.503 | 0,13 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 6.847 | 0,61 |
| **AKTIEN** | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | 18.185 | 182 | 0,02 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 1.702.886** | **152,09** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 41 | $ (47) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 113,800 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[(1)] | Long | 08/2019 | 1.097 | (1) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 134,500 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[(1)] | Short | 08/2019 | 161 | (4) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[(1)] | Short | 07/2019 | 73 | (182) | (0,02) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[(1)] | Short | 07/2019 | 67 | (136) | (0,01) |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09/2019 | 7 | (1) | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2019 | 168 | (855) | (0,08) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 695 | 1.041 | 0,09 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 116 | (585) | (0,05) |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 433 | (1.657) | (0,15) |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09/2019 | 1.618 | (238) | (0,02) |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 6 | 3 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 112,100 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[(1)] | Short | 08/2019 | 508 | 25 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 129,750 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[(1)] | Long | 08/2019 | 511 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 154,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[(1)] | Long | 08/2019 | 667 | (1) | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 159,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[(1)] | Long | 08/2019 | 260 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[(1)] | Short | 07/2019 | 73 | 82 | 0,01 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[(1)] | Short | 07/2019 | 67 | 66 | 0,01 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 314 | 154 | 0,01 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09/2019 | 85 | (133) | (0,01) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 4 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ (2.469) | (0,22) |

(1) Future-Style-Option.

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | $ 220,000 | 23.08.2019 | 6 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 145,500 | 23.08.2019 | 632 | 6 | 1 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 230,000 | 23.08.2019 | 29 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 104,125 | 23.08.2019 | 584 | 5 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 108,000 | 23.08.2019 | 108 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 12 | $ 1 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 129,000 | 26.07.2019 | 57 | $ (14) | $ (15) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (2.483)** | **(0,22)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Ally Financial, Inc. | 5,000 % | 20.06.2022 | $ 100 | $ 0 | 0,00 |
| Daimler AG | 1,000 | 20.12.2020 | € 650 | (1) | 0,00 |
| Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2019 | 200 | 0 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2020 | $ 300 | 11 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 500 | 33 | 0,00 |
| Simon Property Group LP | 1,000 | 20.06.2022 | 4.000 | 86 | 0,01 |
| | | | | $ 129 | 0,01 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-31 5-Year Index | (5,000) % | 20.12.2023 | $ 4.559 | $ (125) | (0,01) |
| CDX.HY-32 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2024 | 1.900 | (1) | 0,00 |
| | | | | $ (126) | (0,01) |

### 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 | 2,000 % | 15.12.2047 | $ 8.110 | $ (55) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,428 | 20.12.2047 | 1.400 | (146) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,478 | 20.12.2047 | 2.494 | (300) | (0,03) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,499 | 20.12.2047 | 1.160 | (140) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 21.12.2026 | 9.060 | 304 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 16.12.2022 | 16.100 | 164 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 10.640 | (896) | (0,08) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,400 | 07.12.2026 | 29.570 | (1.005) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 8.980 | (1.598) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 6.500 | (1.500) | (0,13) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 3,100 | 17.04.2028 | 19.350 | (843) | (0,08) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | € 10.300 | (13) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.09.2021 | £ 44.600 | (352) | (0,03) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 6.590 | (677) | (0,06) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 20.03.2029 | ¥ 133.300 | (48) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,066 | 15.02.2024 | € 14.500 | 139 | 0,01 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,232 | 15.12.2023 | 23.700 | (520) | (0,05) |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,570 | 15.03.2039 | 700 | 55 | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,796 | 15.11.2038 | 555 | 84 | 0,01 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,808 | 15.11.2038 | 850 | 131 | 0,01 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,945 | 15.11.2048 | 650 | 171 | 0,02 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,946 | 15.03.2048 | 800 | 203 | 0,02 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,816 | 13.05.2021 | $ 19.300 | (24) | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,954 | 03.06.2029 | 4.700 | 14 | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,550 | 26.07.2021 | 1.100 | (15) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,577 | 24.11.2020 | 2.700 | (13) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,603 | 12.09.2021 | 1.240 | (18) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,678 | 24.05.2021 | 4.000 | 23 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,845 | 24.05.2026 | 1.000 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,875 | 14.03.2021 | 600 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,927 | 18.03.2021 | 27.200 | (72) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 1,957 | 20.03.2020 | 68.200 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,021 | 25.11.2020 | 4.100 | (10) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,027 | 23.11.2020 | 4.100 | (11) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,069 | 15.07.2022 | 4.000 | (35) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,168 | 15.07.2020 | 10.700 | (61) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,210 | 05.02.2023 | 17.550 | (347) | (0,03) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,220 | 13.04.2023 | 7.440 | (174) | (0,02) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,263 | 27.04.2023 | 60 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,263 | 09.05.2023 | 5.230 | (134) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,281 | 10.05.2023 | 7.960 | (225) | (0,02) |

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | CPURNSA | 2,335 % | 05.02.2028 | $ 6.110 | $ 264 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,353 | 09.05.2028 | 960 | 48 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,364 | 10.05.2028 | 7.960 | 405 | 0,04 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,379 | 09.07.2028 | 1.900 | 99 | 0,01 |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,000 | 15.04.2020 | € 1.650 | (5) | 0,00 |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,160 | 15.08.2020 | 140 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,345 | 15.06.2021 | 22.910 | (343) | (0,03) |
| Erhalt | FRCPXTOB | 1,590 | 15.02.2028 | 2.810 | 203 | 0,02 |
| Erhalt | UKRPI | 3,100 | 15.06.2031 | £ 1.880 | (23) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,140 | 15.04.2031 | 210 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,300 | 15.12.2030 | 3.080 | 43 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,470 | 15.09.2032 | 8.470 | (125) | (0,01) |
| Erhalt | UKRPI | 3,500 | 15.09.2033 | 3.040 | (53) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,530 | 15.10.2031 | 20.660 | (255) | (0,02) |
| Erhalt | UKRPI | 3,579 | 15.10.2033 | 3.830 | 46 | 0,00 |
| | | | | | $ (7.645) | (0,68) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (7.642)** | **(0,68)** |

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

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF WERTPAPIERE**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[(1)] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FAR | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2049 | $ 76,500 | 08.07.2019 | 38.400 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[(1)] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 3.100 | $ (3) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 2.300 | (3) | (1) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 2.600 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 3.800 | (6) | (1) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 6.000 | (13) | (2) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 2.400 | (3) | 0 | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 1.400 | (2) | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 2.200 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 2.300 | (4) | (1) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 2.600 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 1.100 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 3.000 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 4.600 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 3.300 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 1.000 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 2.700 | (4) | (1) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 1.300 | (2) | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 2.200 | (2) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (66) | $ (10) | 0,00 |

**INFLATION-CAPPED OPTIONS**

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag[(1)] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Cap - OTC CPALEMU | $ 100,151 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035 | 1.500 | $ (68) | $ (2) | 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 |
| | Floor - OTC YOY CPURNSA | 234,812 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 24.03.2020 | 4.600 | (52) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (128) | $ (2) | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

## ZINSCAPS

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2] | 10-Year USD-ISDA - 2-Year USD-ISDA | 0,000 % | 02.01.2020 | 120.500 | $ (94) | $ (14) | 0,00 |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

[2] Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Mexico Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 2.900 | $ 28 | $ (29) | $ (1) | 0,00 |
| BPS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 150 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 5.200 | 47 | (48) | (1) | 0,00 |
| GST | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 900 | 8 | (8) | 0 | 0,00 |
| HUS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 2.150 | 19 | (20) | (1) | 0,00 |
| | | | | | $ 103 | $ (106) | $ (3) | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 % | 17.01.2047 | $ 2.887 | $ (145) | $ 176 | $ 31 | 0,00 |
| | 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) | 1 | (2) | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 900 | (80) | 89 | 9 | 0,00 |
| | | | | | $ (268) | $ 313 | $ 45 | 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 | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | CPURNSA | 1,570 % | 23.11.2020 | $ 12.200 | $ 0 | $ 174 | $ 174 | 0,02 |
| BRC | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,374) | 20.06.2020 | ILS 13.060 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,950 | 20.06.2028 | 2.810 | 0 | 39 | 39 | 0,00 |
| DUB | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 2,100 | 20.06.2028 | 2.690 | 0 | 47 | 47 | 0,00 |
| GLM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | 10.240 | 1 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,290) | 16.02.2020 | 24.820 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,270) | 21.03.2020 | 15.260 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,883 | 21.03.2028 | 3.200 | 0 | 45 | 45 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,971 | 16.02.2028 | 5.230 | 0 | 89 | 89 | 0,01 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 2.190 | 0 | 33 | 33 | 0,00 |
| HUS | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | 8.080 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 1.730 | 0 | 26 | 26 | 0,00 |
| JPM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,420) | 20.06.2020 | 12.620 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MYC | Erhalt | CPURNSA | (1,810) | 19.07.2026 | $ 1.900 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | Erhalt | CPURNSA | (1,805) | 20.09.2026 | 500 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | Erhalt | CPURNSA | (1,800) | 20.07.2026 | 1.300 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | Erhalt | CPURNSA | (1,787) | 18.07.2026 | 2.000 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | | | | | | $ 1 | $ 355 | $ 356 | 0,03 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD 119 | $ 82 | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 19.766 | AUD 28.342 | 123 | 0 | 123 | 0,01 |
| | 07/2019 | 8.346 | CAD 10.977 | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| | 07/2019 | 680 | € 600 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD 23.339 | $ 16.316 | 0 | (80) | (80) | (0,01) |
| | 08/2019 | CAD 10.977 | 8.352 | 0 | (55) | (55) | (0,01) |
| | 10/2019 | DKK 6.844 | 1.051 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 11/2019 | TWD | 32.645 | $ | 1.041 | $ 0 | $ (20) | $ (20) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | ¥ | 271.000 | | 2.535 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 1.380 | | 906 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 40 | ARS | 1.954 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.749 | € | 3.322 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 226.314 | £ | 178.431 | 775 | 0 | 775 | 0,07 |
| | 08/2019 | ARS | 16.495 | $ | 370 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 178.431 | | 226.661 | 0 | (782) | (782) | (0,07) |
| | 08/2019 | $ | 1.348 | MXN | 26.875 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 19.145 | $ | 2.944 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 26.875 | | 1.334 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | DKK | 96.285 | | 14.507 | 0 | (184) | (184) | (0,02) |
| | 07/2019 | € | 317.858 | | 355.488 | 0 | (6.489) | (6.489) | (0,58) |
| | 08/2019 | MXN | 25.087 | | 1.263 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 04/2020 | DKK | 36.475 | | 5.697 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | ARS | 1.954 | | 40 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | AUD | 28.223 | | 19.538 | 0 | (267) | (267) | (0,02) |
| | 07/2019 | DKK | 9.665 | | 1.478 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 898 | | 1.137 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 1.458.200 | | 13.423 | 12 | (123) | (111) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 25.308 | DKK | 166.398 | 81 | 0 | 81 | 0,01 |
| | 08/2019 | PEN | 6.202 | $ | 1.844 | 0 | (40) | (40) | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 166.398 | | 25.503 | 0 | (80) | (80) | (0,01) |
| | 10/2019 | PEN | 18.501 | | 5.477 | 0 | (124) | (124) | (0,01) |
| GLM | 07/2019 | € | 1.438 | | 1.619 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 692 | | 881 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.707 | € | 5.922 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 5.767 | RUB | 379.081 | 206 | 0 | 206 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 5.580 | IDR | 81.882.518 | 161 | 0 | 161 | 0,01 |
| | 10/2019 | | 1.376 | MXN | 26.875 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 10.977 | $ | 8.143 | 0 | (257) | (257) | (0,02) |
| | 07/2019 | £ | 96 | | 122 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 329 | € | 289 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 15 | £ | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 198.400 | $ | 1.845 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 3.881 | | 2.840 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 104.542 | | 3.339 | 0 | (57) | (57) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | € | 11.493 | | 13.003 | 0 | (86) | (86) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 5.285 | € | 4.718 | 88 | 0 | 88 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 2.746 | ZAR | 39.993 | 88 | 0 | 88 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | DKK | 59.290 | $ | 9.018 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 51 | £ | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 176.841 | $ | 223.828 | 0 | (1.238) | (1.238) | (0,11) |
| | 07/2019 | SEK | 97.880 | | 10.229 | 0 | (320) | (320) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 10.555 | SEK | 97.880 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 97.880 | $ | 10.579 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 6.394.295 | | 5.372 | 0 | (164) | (164) | (0,01) |
| | 11/2019 | TWD | 41.624 | | 1.330 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ | 5.223 | COP | 17.701.894 | 289 | 0 | 289 | 0,03 |
| UAG | 07/2019 | DKK | 1.805 | $ | 276 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 16.066 | ¥ | 1.729.200 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 1.729.200 | $ | 16.104 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 811 | | 117 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 04/2020 | DKK | 38.260 | | 5.989 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 04/2020 | $ | 282 | DKK | 1.805 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 2.072 | $ (10.602) | $ (8.530) | (0,76) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | $ | 1.983 | CHF | 1.989 | $ 57 | $ 0 | $ 57 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | CHF | 1.967 | $ | 2.009 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.987 | CHF | 1.991 | 55 | 0 | 55 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.015 | | 1.967 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 1.985 | | 1.998 | 64 | 0 | 64 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 2.015 | $ | 2.062 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.068 | CHF | 2.015 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CHF | 138 | $ | 141 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1 | CHF | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 189 | $ (13) | $ 176 | 0,02 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Low Duration Real Return Fund (Forts.)

Zum 30. Juni 2019 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 214.339 | $ 243.575 | $ 0 | $ (515) | $ (515) | (0,05) |
| | 08/2019 | $ 244.196 | € 214.339 | 518 | 0 | 518 | 0,05 |
| BPS | 07/2019 | € 214.320 | $ 243.625 | 0 | (443) | (443) | (0,04) |
| | 08/2019 | $ 238.118 | € 208.894 | 378 | 0 | 378 | 0,03 |
| BRC | 07/2019 | 238.620 | 213.360 | 4.354 | 0 | 4.354 | 0,39 |
| CBK | 07/2019 | € 214.918 | $ 244.256 | 0 | (493) | (493) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ 1.137 | € 1.006 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08/2019 | 244.218 | 214.339 | 495 | 0 | 495 | 0,05 |
| GLM | 07/2019 | 704 | 625 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 239.443 | 214.133 | 4.412 | 0 | 4.412 | 0,39 |
| RYL | 07/2019 | € 103 | $ 117 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 565 | € 499 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € 230 | $ 258 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 277 | € 246 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | 239.445 | 214.133 | 4.410 | 0 | 4.410 | 0,39 |
| | | | | $ 14.590 | $ (1.456) | $ 13.134 | 1,17 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | £ 2.236 | $ 2.815 | $ 0 | $ (31) | $ (31) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 1.219 | £ 963 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 58.000 | $ 73.565 | 0 | (252) | (252) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ 1.853 | £ 1.465 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 08/2019 | 73.677 | 58.000 | 254 | 0 | 254 | 0,02 |
| CBK | 07/2019 | £ 57.718 | $ 73.336 | 0 | (121) | (121) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 71.576 | £ 56.490 | 319 | 0 | 319 | 0,03 |
| | 08/2019 | 73.449 | 57.718 | 123 | 0 | 123 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | 816 | 645 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 171 | 134 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 3.429 | 2.712 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 71.421 | 56.428 | 395 | 0 | 395 | 0,03 |
| SSB | 07/2019 | 70.442 | 55.749 | 510 | 0 | 510 | 0,05 |
| | | | | $ 1.648 | $ (405) | $ 1.243 | 0,11 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 6.395** | **0,57** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 49.400 | $ (49.785) | (4,45) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (49.785)** | **(4,45)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 1.649.371** | **147,31** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (529.735)** | **(47,31)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 1.119.636** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(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) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 611.760 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 696 und Barmittel in Höhe von 2.580 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 10.926 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 3.570 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(g) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 1.503 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (1.535) | $ 1.503 | $ 1.503 | 0,13 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.535)** | **$ 1.503** | **$ 1.503** | **0,13** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 182 | $ 1.692.729 | $ 9.975 | $ 1.702.886 |
| Finanzderivate[3] | (2.483) | (1.247) | 0 | (3.730) |
| Leerverkäufe | 0 | (49.785) | 0 | (49.785) |
| **Summen** | **$ (2.301)** | **$ 1.641.697** | **$ 9.975** | **$ 1.649.371** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 14.209 | $ 1.764.770 | $ 9.950 | $ 1.788.929 |
| Finanzderivate[3] | (5.693) | 1.044 | 0 | (4.649) |
| Leerverkäufe | 0 | (35.482) | 0 | (35.482) |
| **Summen** | **$ 8.516** | **$ 1.730.332** | **$ 9.950** | **$ 1.748.798** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkaufgeschäfte[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPG | 2,560 % | 16.05.2019 | 16.07.2019 | $ (91.680) | $ (91.979) | (8,22) |
| | 2,570 | 06.05.2019 | 06.08.2019 | (33.168) | (33.300) | (2,97) |
| | 2,580 | 12.06.2019 | 24.07.2019 | (131.670) | (131.850) | (11,78) |
| | 2,600 | 16.04.2019 | 16.07.2019 | (200.498) | (201.599) | (18,01) |
| | 2,610 | 23.04.2019 | 23.07.2019 | (45.956) | (46.186) | (4,12) |
| | 2,610 | 25.04.2019 | 16.07.2019 | (63.346) | (63.654) | (5,69) |
| | 2,650 | 21.06.2019 | 02.08.2019 | (25.574) | (25.593) | (2,29) |
| | 2,660 | 10.06.2019 | 10.07.2019 | (5.647) | (5.655) | (0,50) |
| TDM | 2,550 | 10.04.2019 | 10.07.2019 | (4.728) | (4.755) | (0,42) |
| | 2,600 | 23.04.2019 | 12.07.2019 | (14.754) | (14.828) | (1,32) |
| **Summe Rückkaufgeschäfte** | | | | | **$ (619.399)** | **(55,32)** |

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 838 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 230 | $ (260) | $ (30) |
| BPS | (22) | 0 | (22) |
| BRC | (2.310) | 2.090 | (220) |
| CBK | (162) | 310 | 148 |
| DUB | 45 | (20) | 25 |
| FBF | (1) | 0 | (1) |
| GLM | 617 | (730) | (113) |
| GST | 35 | 0 | 35 |
| HUS | (324) | 310 | (14) |
| JPM | 86 | 0 | 86 |
| MYC | (95) | (180) | (275) |
| MYI | 4.406 | (4.020) | 386 |
| RYL | 3 | 0 | 3 |
| SAL | (2) | 0 | (2) |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| SCX | $ (1.350) | $ 860 | $ (490) |
| SSB | 510 | (400) | 110 |
| TOR | 4.699 | (4.490) | 209 |
| UAG | 30 | (260) | (230) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 123,40 | 72,49 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 28,56 | 82,27 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,13 | 0,22 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,22) | (0,49) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,68) | (0,13) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,57 | 0,22 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (4,45) | (3,07) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (55,32) | (36,43) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,15 | 0,25 |
| Australien | 1,49 | 2,40 |
| Brasilien | 0,02 | 0,02 |
| Kanada | 1,03 | 0,94 |
| Cayman-Inseln | 0,11 | 0,09 |
| Dänemark | 4,14 | 0,00 |
| Frankreich | 14,99 | 9,23 |
| Deutschland | 0,28 | 0,28 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,06 | 0,05 |
| Hongkong | 0,22 | 0,21 |
| Indien | 0,48 | 0,47 |
| Irland | 2,01 | 2,17 |
| Italien | 6,66 | 7,52 |
| Japan | 2,81 | 1,59 |
| Luxemburg | 0,21 | 0,31 |
| Niederlande | 1,81 | 1,65 |
| Neuseeland | 0,08 | 0,08 |
| Peru | 0,64 | 0,56 |
| Katar | 1,19 | 1,13 |
| Singapur | 0,00 | 0,02 |
| Spanien | 6,38 | 3,74 |
| Schweden | 0,95 | 0,95 |
| Schweiz | 0,59 | 0,57 |
| Großbritannien | 20,98 | 18,60 |
| Vereinigte Staaten | 84,18 | 96,28 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,61 | 4,64 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,02 | 1,23 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,22) | (0,48) |
| 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 | (0,01) | 0,03 |
| Zinsswaps | (0,68) | (0,17) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,01) |
| Zinscaps | 0,00 | (0,01) |
| Zinsswaps | 0,03 | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | (0,76) | 0,12 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,30 | 0,12 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (4,45) | (3,07) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (47,31) | (51,51) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.07.2020 | $ | 200 | $ 203 | 0,02 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 200 | 205 | 0,02 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(g) | € | 200 | 236 | 0,03 |
| 8,875 % fällig am 14.04.2021 (e)(g) | | 1.200 | 1.525 | 0,18 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.09.2023 (e)(g) | | 400 | 464 | 0,05 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (e)(g) | | 400 | 480 | 0,06 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2028 (e) | $ | 650 | 679 | 0,08 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 1.300 | 1.348 | 0,16 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 4.800 | 4.868 | 0,56 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,610 % fällig am 15.09.2020 | | 9.900 | 9.997 | 1,16 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | | 1.400 | 1.428 | 0,17 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 7,000 % fällig am 19.01.2021 (e)(g) | € | 3.100 | 3.725 | 0,43 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 45.800 | 6.895 | 0,80 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 7 | 1 | 0,00 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,186 % fällig am 21.06.2021 | $ | 700 | 701 | 0,08 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 2.100 | 2.179 | 0,25 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 35.800 | 5.391 | 0,63 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 53 | 8 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 60.200 | 9.066 | 1,05 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 10 | 2 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | | 70 | 11 | 0,00 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | $ | 1.000 | 999 | 0,12 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 700 | 730 | 0,08 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 3,539 % fällig am 06.04.2020 | | 1.100 | 1.103 | 0,13 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.03.2021 | | 2.000 | 2.007 | 0,23 |
| **UBS AG** | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.12.2020 | | 5.700 | 5.709 | 0,66 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 9.100 | 10.402 | 1,21 |
| | | | 70.462 | 8,17 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | | 1.500 | 1.504 | 0,18 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | | 2.100 | 2.103 | 0,24 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 1.400 | 1.443 | 0,17 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | | 700 | 703 | 0,08 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2023 | | 700 | 704 | 0,08 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 1.100 | 1.094 | 0,13 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 1.600 | 1.601 | 0,19 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 3,202 % fällig am 18.09.2020 | | 3.800 | 3.803 | 0,44 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | | |
| 3,922 % fällig am 01.06.2021 | | 100 | 102 | 0,01 |
| **Mitsubishi Corp.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 14.07.2022 | $ | 2.300 | $ 2.315 | 0,27 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 21.08.2027 | | 200 | 203 | 0,02 |
| **Wind Tre SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 20.01.2023 | € | 1.200 | 1.380 | 0,16 |
| | | | 16.955 | 1,97 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **American Transmission Systems, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2022 | $ | 100 | 106 | 0,01 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | | 1.400 | 1.407 | 0,16 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 2.500 | 2.523 | 0,29 |
| 5,150 % fällig am 15.02.2050 | | 1.600 | 1.769 | 0,21 |
| 5,300 % fällig am 15.08.2058 | | 500 | 558 | 0,06 |
| **Consolidated Edison Co. of New York, Inc.** | | | | |
| 2,749 % fällig am 25.06.2021 | | 300 | 301 | 0,04 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 30.06.2021 | | 500 | 501 | 0,06 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | | 1.880 | 1.881 | 0,22 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 1.222 | 1.312 | 0,15 |
| 7,250 % fällig am 17.03.2044 | | 4.700 | 5.269 | 0,61 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 800 | 797 | 0,09 |
| | | | 16.424 | 1,90 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 103.841 | 12,04 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 4,176 % fällig am 25.03.2036 (a) | | 292 | 56 | 0,01 |
| 4,607 % fällig am 01.05.2038 | | 2.884 | 3.028 | 0,35 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.01.2048 | | 163 | 168 | 0,02 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 191.447 | 195.707 | 22,69 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | | 164.200 | 169.690 | 19,67 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 3,706 % fällig am 15.08.2043 (a) | | 1.221 | 178 | 0,02 |
| 5,760 % fällig am 15.05.2035 | | 206 | 246 | 0,03 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 2,783 % fällig am 20.02.2049 | | 4.242 | 4.239 | 0,49 |
| 3,030 % fällig am 20.08.2068 | | 1.708 | 1.676 | 0,19 |
| | | | 374.988 | 43,47 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 (i) | | 78.257 | 77.659 | 9,00 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 | | 3.603 | 3.580 | 0,42 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (i) | | 7.130 | 7.141 | 0,83 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 (i) | | 6.677 | 6.753 | 0,78 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | | 719 | 724 | 0,09 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | | 449 | 454 | 0,05 |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 | | 8.049 | 8.101 | 0,94 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | | 23 | 23 | 0,00 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 (i) | | 5.527 | 5.662 | 0,66 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | | 3.036 | 3.197 | 0,37 |
| 1,125 % fällig am 15.01.2021 | | 8.293 | 8.359 | 0,97 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | | 331 | 368 | 0,04 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 (i) | | 14.209 | 18.199 | 2,11 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | | 1.388 | 1.790 | 0,21 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (i) | | 8.811 | 9.849 | 1,14 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 (i) | | 3.712 | 4.467 | 0,52 |
| 3,375 % fällig am 15.04.2032 | | 2.273 | 3.116 | 0,36 |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 | | 316 | 423 | 0,05 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 1,875 % fällig am 30.06.2026 (b) | | 13.300 | 13.306 | 1,54 |
| | | | 173.171 | 20,08 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 4,260 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 114 | 109 | 0,01 |
| 4,333 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 259 | 251 | 0,03 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | $ | 1.552 | $ 1.566 | 0,18 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 66 | 49 | 0,01 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,684 % fällig am 25.07.2035 | | 170 | 155 | 0,02 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 3.400 | 4.344 | 0,50 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,734 % fällig am 25.01.2045 | $ | 3.963 | 3.939 | 0,46 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 746 | 620 | 0,07 |
| | | | 11.033 | 1,28 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 4,204 % fällig am 25.06.2034 | | 294 | 286 | 0,03 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 1.768 | 1.542 | 0,18 |
| 2,564 % fällig am 25.05.2036 | | 463 | 175 | 0,02 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 26.04.2029 | € | 900 | 1.026 | 0,12 |
| **Babson Euro CLO BV** | | | | |
| 0,509 % fällig am 25.10.2029 | | 300 | 340 | 0,04 |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 400 | 457 | 0,05 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 21.09.2029 | | 300 | 342 | 0,04 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,780 % fällig am 25.10.2037 | $ | 3.244 | 3.289 | 0,38 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.05.2037 | | 11.500 | 11.024 | 1,28 |
| **CVP Cascade CLO Ltd.** | | | | |
| 3,751 % fällig am 16.01.2026 | | 580 | 579 | 0,07 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | € | 200 | 228 | 0,03 |
| **Driver Australia Four Trust** | | | | |
| 2,185 % fällig am 21.08.2025 | AUD | 796 | 559 | 0,06 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.10.2027 | $ | 2.400 | 2.397 | 0,28 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.11.2036 | | 2.200 | 1.996 | 0,23 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.10.2036 | | 8.141 | 4.050 | 0,47 |
| **Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.** | | | | |
| 3,512 % fällig am 20.04.2027 | | 899 | 897 | 0,10 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 1.400 | 1.594 | 0,18 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | | 360 | 409 | 0,05 |
| **Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust** | | | | |
| 7,170 % fällig am 15.04.2040 ^ | $ | 1.182 | 868 | 0,10 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.01.2036 | | 3.103 | 2.909 | 0,34 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,534 % fällig am 25.10.2036 | | 133 | 128 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.10.2036 | | 1.417 | 877 | 0,10 |
| **Navient Student Loan Trust** | | | | |
| 3,554 % fällig am 25.03.2066 | | 1.334 | 1.340 | 0,16 |
| **North Westerly CLO BV** | | | | |
| 0,644 % fällig am 15.01.2026 | € | 4.274 | 4.869 | 0,56 |
| 1,250 % fällig am 15.01.2026 | | 777 | 885 | 0,10 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.11.2036 ^ | $ | 3.679 | 3.261 | 0,38 |
| **Sound Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,472 % fällig am 20.07.2027 | | 400 | 400 | 0,05 |
| **THL Credit Wind River CLO Ltd.** | | | | |
| 3,467 % fällig am 15.10.2027 | | 250 | 250 | 0,03 |
| **Tralee CLO Ltd.** | | | | |
| 3,622 % fällig am 20.10.2027 | | 1.200 | 1.200 | 0,14 |
| **Tymon Park CLO Ltd.** | | | | |
| 0,590 % fällig am 21.01.2029 | € | 500 | 568 | 0,07 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| Venture CLO Ltd. | | | | |
| 3,477 % fällig am 15.07.2027 | $ | 1.000 | $ 1.001 | 0,12 |
| | | | 49.746 | 5,77 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| Argentina Government International Bond | | | | |
| 40,244 % fällig am 04.10.2022 | ARS | 5.300 | 185 | 0,02 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | | 2.663 | 54 | 0,01 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 113.719 | 2.619 | 0,30 |
| Australia Government International Bond | | | | |
| 3,000 % fällig am 20.09.2025 | AUD | 3.186 | 2.671 | 0,31 |
| Autonomous Community of Catalonia | | | | |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | € | 100 | 117 | 0,01 |
| Canadian Government Real Return Bond | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.12.2050 (d) | CAD | 1.151 | 930 | 0,11 |
| France Government International Bond | | | | |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 (d)(i) | € | 3.625 | 4.410 | 0,51 |
| 1,850 % fällig am 25.07.2027 (d)(i) | | 4.071 | 5.801 | 0,67 |
| 2,100 % fällig am 25.07.2023 (d) | | 13.220 | 17.183 | 1,99 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro | | | | |
| 1,650 % fällig am 23.04.2020 (d) | | 502 | 578 | 0,07 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (d)(i) | | 5.730 | 7.036 | 0,82 |
| 2,600 % fällig am 15.09.2023 (d) | | 2.389 | 2.951 | 0,34 |
| Japan Government International Bond | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (d) | ¥ | 671.603 | 6.511 | 0,76 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2029 (d) | | 446.317 | 4.327 | 0,50 |
| New Zealand Government International Bond | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | NZD | 1.840 | 1.351 | 0,16 |
| Peru Government International Bond | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 7.600 | 2.523 | 0,29 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 7.700 | 2.577 | 0,30 |
| Qatar Government International Bond | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 2.000 | 2.100 | 0,24 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 1.500 | 1.791 | 0,21 |
| Spain Government International Bond | | | | |
| 2,150 % fällig am 31.10.2025 | € | 6.300 | 8.148 | 0,95 |
| United Kingdom Gilt | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2026 (d) | £ | 1.116 | 1.695 | 0,20 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2028 (d) | | 10.534 | 16.942 | 1,96 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 (d)(i) | | 10.585 | 18.221 | 2,11 |
| 1,875 % fällig am 22.11.2022 (d) | | 15.395 | 22.811 | 2,64 |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 | | 1.479 | 2.691 | 0,31 |
| | | | 136.223 | 15,79 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (f) | 9.613.789 | 151.898 | 17,61 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Advantage Real Return Fund (f) | 1.491.585 | 11.754 | 1,36 |
| | | 163.652 | 18,97 |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Alphabet, Inc. 'A' (c) | 1.703 | 1.844 | 0,21 |
| Alphabet, Inc. 'C' (c) | 1.768 | 1.911 | 0,22 |
| BT Group PLC | 20.983 | 53 | 0,01 |
| Comcast Corp. 'A' | 5.126 | 217 | 0,03 |
| Discovery, Inc. 'A' (c) | 13.500 | $ 415 | 0,05 |
| Discovery, Inc. 'C' (c) | 13.400 | 381 | 0,04 |
| Eutelsat Communications S.A. | 9.855 | 184 | 0,02 |
| Facebook, Inc. 'A' (c) | 7.664 | 1.479 | 0,17 |
| Hakuhodo DY Holdings, Inc. | 9.100 | 154 | 0,02 |
| ITV PLC | 18.363 | 25 | 0,00 |
| KDDI Corp. | 15.966 | 407 | 0,05 |
| Konami Holdings Corp. | 900 | 42 | 0,00 |
| Koninklijke KPN NV | 41.724 | 128 | 0,01 |
| Netflix, Inc. (c) | 300 | 110 | 0,01 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp. | 6.673 | 311 | 0,04 |
| NTT DOCOMO, Inc. | 25.155 | 587 | 0,07 |
| Omnicom Group, Inc. | 500 | 41 | 0,00 |
| PCCW Ltd. | 301.170 | 174 | 0,02 |
| Proximus SADP | 5.571 | 165 | 0,02 |
| Quebecor, Inc. 'B' | 10.700 | 255 | 0,03 |
| RTL Group S.A. | 5.560 | 285 | 0,03 |
| SES S.A. | 8.681 | 136 | 0,02 |
| SoftBank Group Corp. | 9.800 | 472 | 0,05 |
| Sprint Corp. (c) | 9.000 | 59 | 0,01 |
| Telstra Corp. Ltd. | 22.915 | 62 | 0,01 |
| Thomson Reuters Corp. | 14.100 | 912 | 0,11 |
| Tribune Media Co. 'A' | 87.179 | 4.029 | 0,47 |
| Verizon Communications, Inc. | 12.000 | 686 | 0,08 |
| Viacom, Inc. 'B' | 11.366 | 340 | 0,04 |
| | | 15.864 | 1,84 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Accor S.A. | 9.945 | 428 | 0,05 |
| Amazon.com, Inc. (c) | 1.057 | 2.002 | 0,23 |
| AutoZone, Inc. (c) | 416 | 457 | 0,05 |
| Bandai Namco Holdings, Inc. | 2.900 | 141 | 0,02 |
| Barratt Developments PLC | 36.046 | 263 | 0,03 |
| Berkeley Group Holdings PLC | 8.688 | 413 | 0,05 |
| Compass Group PLC | 4.679 | 112 | 0,01 |
| Darden Restaurants, Inc. | 1.952 | 238 | 0,03 |
| DR Horton, Inc. | 4.720 | 204 | 0,02 |
| eBay, Inc. | 7.100 | 280 | 0,03 |
| Faurecia S.A. | 3.956 | 184 | 0,02 |
| Galaxy Entertainment Group Ltd. | 24.406 | 164 | 0,02 |
| Garmin Ltd. | 1.767 | 141 | 0,02 |
| H&R Block, Inc. | 10.986 | 322 | 0,04 |
| Hennes & Mauritz AB 'B' | 9.161 | 163 | 0,02 |
| Home Depot, Inc. | 3.508 | 730 | 0,08 |
| Honda Motor Co. Ltd. | 22.864 | 592 | 0,07 |
| Kering S.A. | 728 | 430 | 0,05 |
| Kohl's Corp. | 4.174 | 199 | 0,02 |
| L Brands, Inc. | 5.600 | 146 | 0,02 |
| Las Vegas Sands Corp. | 20.531 | 1.213 | 0,14 |
| Magna International, Inc. | 4.800 | 239 | 0,03 |
| Marks & Spencer Group PLC | 7.445 | 20 | 0,00 |
| Mazda Motor Corp. | 11.800 | 122 | 0,01 |
| Nikon Corp. | 2.900 | 41 | 0,00 |
| Nissan Motor Co. Ltd. | 5.600 | 40 | 0,00 |
| Norwegian Cruise Line Holdings Ltd. (c) | 2.400 | 129 | 0,01 |
| Pandora A/S | 1.665 | 59 | 0,01 |
| Persimmon PLC | 10.505 | 267 | 0,03 |
| Peugeot S.A. | 17.678 | 436 | 0,05 |
| PulteGroup, Inc. | 7.500 | 237 | 0,03 |
| Rakuten, Inc. | 16.900 | 202 | 0,02 |
| Ross Stores, Inc. | 1.500 | 149 | 0,02 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd. | 1.946 | 236 | 0,03 |
| Sands China Ltd. | 39.371 | 188 | 0,02 |
| Sekisui Chemical Co. Ltd. | 3.200 | 48 | 0,01 |
| Starbucks Corp. | 5.600 | 469 | 0,05 |
| Subaru Corp. | 9.000 | $ 219 | 0,03 |
| Tapestry, Inc. | 1.600 | 51 | 0,01 |
| Target Corp. | 3.600 | 312 | 0,04 |
| Valeo S.A. | 830 | 27 | 0,00 |
| Wesfarmers Ltd. | 12.714 | 323 | 0,04 |
| Wynn Resorts Ltd. | 1.292 | 160 | 0,02 |
| | | 12.796 | 1,48 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Alimentation Couche-Tard, Inc. 'B' | 8.700 | 549 | 0,06 |
| Altria Group, Inc. | 11.182 | 529 | 0,06 |
| Asahi Group Holdings Ltd. | 5.100 | 230 | 0,03 |
| Clorox Co. | 2.931 | 449 | 0,05 |
| Coca-Cola European Partners PLC | 4.200 | 237 | 0,03 |
| Colgate-Palmolive Co. | 8.800 | 631 | 0,07 |
| Hormel Foods Corp. | 9.900 | 401 | 0,05 |
| Imperial Brands PLC | 1.616 | 38 | 0,01 |
| Ingredion, Inc. | 5.237 | 432 | 0,05 |
| Japan Tobacco, Inc. | 25.055 | 553 | 0,06 |
| Kimberly-Clark Corp. | 9.111 | 1.214 | 0,14 |
| Kirin Holdings Co. Ltd. | 13.315 | 288 | 0,03 |
| Kroger Co. | 12.794 | 278 | 0,03 |
| PepsiCo, Inc. | 12.828 | 1.682 | 0,20 |
| Philip Morris International, Inc. | 7.646 | 600 | 0,07 |
| Procter & Gamble Co. | 13.300 | 1.458 | 0,17 |
| Unilever NV | 3.909 | 238 | 0,03 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 1.800 | 199 | 0,02 |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | 7.500 | 410 | 0,05 |
| Woolworths Group Ltd. | 2.777 | 65 | 0,01 |
| | | 10.481 | 1,22 |
| **ENERGIE** | | | |
| Aker BP ASA | 13.286 | 384 | 0,04 |
| Apache Corp. | 11.800 | 342 | 0,04 |
| Canadian Natural Resources Ltd. | 12.283 | 332 | 0,04 |
| Cimarex Energy Co. | 1.300 | 77 | 0,01 |
| ConocoPhillips | 12.953 | 790 | 0,09 |
| Devon Energy Corp. | 3.100 | 89 | 0,01 |
| Dommo Energia S.A. (c)(h) | 75.768 | 54 | 0,01 |
| Eni SpA | 67.506 | 1.124 | 0,13 |
| HollyFrontier Corp. | 7.526 | 348 | 0,04 |
| John Wood Group PLC | 11.044 | 64 | 0,01 |
| JXTG Holdings, Inc. | 28.450 | 142 | 0,02 |
| Kinder Morgan, Inc. | 8.300 | 173 | 0,02 |
| Lundin Petroleum AB | 1.096 | 34 | 0,00 |
| Marathon Oil Corp. | 11.208 | 159 | 0,02 |
| Phillips 66 | 4.500 | 421 | 0,05 |
| Total S.A. | 11.645 | 654 | 0,07 |
| Woodside Petroleum Ltd. | 5.564 | 143 | 0,02 |
| WPX Energy, Inc. (c) | 24.355 | 280 | 0,03 |
| | | 5.610 | 0,65 |
| **FINANZWESEN** | | | |
| 3i Group PLC | 34.387 | 488 | 0,06 |
| ABN AMRO Bank NV | 18.632 | 399 | 0,05 |
| Aflac, Inc. | 32.248 | 1.768 | 0,21 |
| AIB Group PLC | 42.961 | 176 | 0,02 |
| Ally Financial, Inc. | 1.400 | 43 | 0,01 |
| American Express Co. | 4.300 | 531 | 0,06 |
| Ameriprise Financial, Inc. | 300 | 44 | 0,01 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | 93.503 | 522 | 0,06 |
| Bank Leumi Le-Israel BM | 60.948 | 441 | 0,05 |
| Bank of America Corp. | 21.000 | 609 | 0,07 |
| BNP Paribas S.A. | 6.532 | 310 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| Cincinnati Financial Corp. | 2.100 | $ 218 | 0,03 |
| Citizens Financial Group, Inc. | 10.486 | 371 | 0,04 |
| Commonwealth Bank of Australia | 8.106 | 471 | 0,06 |
| Direct Line Insurance Group PLC | 79.793 | 337 | 0,04 |
| Discover Financial Services | 11.364 | 882 | 0,10 |
| DNB ASA | 19.527 | 364 | 0,04 |
| Fifth Third Bancorp | 27.092 | 756 | 0,09 |
| Franklin Resources, Inc. | 15.700 | 546 | 0,06 |
| Gjensidige Forsikring ASA | 5.468 | 110 | 0,01 |
| Hannover Rueck SE | 2.452 | 397 | 0,05 |
| Huntington Bancshares, Inc. | 31.611 | 437 | 0,05 |
| iA Financial Corp., Inc. | 2.400 | 98 | 0,01 |
| IGM Financial, Inc. | 18.613 | 533 | 0,06 |
| ING Groep NV | 26.698 | 310 | 0,04 |
| Investor AB 'B' | 18.500 | 890 | 0,10 |
| JPMorgan Chase & Co. | 6.852 | 766 | 0,09 |
| KBC Group NV | 6.759 | 444 | 0,05 |
| KeyCorp. | 6.500 | 115 | 0,01 |
| KKR & Co., Inc. | 18.100 | 457 | 0,05 |
| Macquarie Group Ltd. | 3.099 | 273 | 0,03 |
| Mediobanca SpA | 16.605 | 172 | 0,02 |
| MetLife, Inc. | 5.400 | 268 | 0,03 |
| ORIX Corp. | 31.989 | 478 | 0,06 |
| Principal Financial Group, Inc. | 1.000 | 58 | 0,01 |
| Progressive Corp. | 6.300 | 504 | 0,06 |
| S&P Global, Inc. | 2.044 | 466 | 0,05 |
| Sampo Oyj 'A' | 10.936 | 517 | 0,06 |
| Singapore Exchange Ltd. | 10.800 | 63 | 0,01 |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | 57.954 | 537 | 0,06 |
| Swedbank AB 'A' | 17.447 | 263 | 0,03 |
| Synchrony Financial | 13.244 | 459 | 0,05 |
| T Rowe Price Group, Inc. | 8.990 | 986 | 0,11 |
| Torchmark Corp. | 3.219 | 288 | 0,03 |
| Wells Fargo & Co. | 33.049 | 1.564 | 0,18 |
| Westpac Banking Corp. | 35.976 | 717 | 0,08 |
| Zurich Insurance Group AG | 475 | 165 | 0,02 |
| | | 21.611 | 2,51 |

**GESUNDHEITSWESEN**

| | | | |
|---|---|---|---|
| AbbVie, Inc. | 8.018 | 583 | 0,07 |
| AmerisourceBergen Corp. | 1.000 | 85 | 0,01 |
| Amgen, Inc. | 6.223 | 1.147 | 0,13 |
| Array BioPharma, Inc. (c) | 72.151 | 3.343 | 0,39 |
| Astellas Pharma, Inc. | 43.877 | 626 | 0,07 |
| Biogen, Inc. (c) | 2.294 | 537 | 0,06 |
| Bristol-Myers Squibb Co. | 7.700 | 349 | 0,04 |
| BTG PLC (c) | 330.284 | 3.512 | 0,41 |
| Carl Zeiss Meditec AG | 693 | 68 | 0,01 |
| Celgene Corp. (c) | 2.800 | 259 | 0,03 |
| Cerner Corp. | 6.400 | 469 | 0,05 |
| Cronos Group, Inc. (c) | 7.200 | 116 | 0,01 |
| Edwards Lifesciences Corp. (c) | 600 | 111 | 0,01 |
| Eisai Co. Ltd. | 2.100 | 119 | 0,01 |
| Eli Lilly & Co. | 2.900 | 321 | 0,04 |
| Gilead Sciences, Inc. | 8.674 | 586 | 0,07 |
| H Lundbeck A/S | 2.770 | 110 | 0,01 |
| Henry Schein, Inc. (c) | 7.900 | 552 | 0,06 |
| Hoya Corp. | 7.000 | 538 | 0,06 |
| Jazz Pharmaceuticals PLC (c) | 200 | 29 | 0,00 |
| Johnson & Johnson | 9.582 | 1.335 | 0,16 |
| Koninklijke Philips NV | 16.770 | 730 | 0,08 |
| Medtronic PLC | 9.810 | 955 | 0,11 |
| Merck & Co., Inc. | 8.901 | 746 | 0,09 |
| Nektar Therapeutics (c) | 1.000 | 36 | 0,00 |
| Novo Nordisk A/S 'B' | 7.661 | 392 | 0,05 |
| Olympus Corp. | 6.124 | $ 68 | 0,01 |
| Orion Oyj 'B' | 4.041 | 148 | 0,02 |
| Pfizer, Inc. | 18.926 | 820 | 0,10 |
| Roche Holding AG | 6.880 | 1.937 | 0,23 |
| Shionogi & Co. Ltd. | 6.400 | 370 | 0,04 |
| Siemens Healthineers AG | 14.644 | 618 | 0,07 |
| Smith & Nephew PLC | 18.401 | 400 | 0,05 |
| Sonova Holding AG | 1.964 | 448 | 0,05 |
| Spark Therapeutics, Inc. (c) | 29.551 | 3.025 | 0,35 |
| Sumitomo Dainippon Pharma Co. Ltd. | 4.172 | 80 | 0,01 |
| Suzuken Co. Ltd. | 900 | 53 | 0,01 |
| UCB S.A. | 2.367 | 197 | 0,02 |
| Universal Health Services, Inc. 'B' | 698 | 91 | 0,01 |
| Veeva Systems, Inc. (c) | 1.100 | 178 | 0,02 |
| | | 26.087 | 3,02 |

**INDUSTRIEWERTE**

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3M Co. | 3.500 | 607 | 0,07 |
| Acuity Brands, Inc. | 1.100 | 152 | 0,02 |
| Advanced Disposal Services, Inc. (c) | 104.480 | 3.334 | 0,39 |
| Aena SME S.A. | 1.050 | 208 | 0,02 |
| Arconic, Inc. | 8.100 | 209 | 0,02 |
| Ashtead Group PLC | 22.641 | 650 | 0,07 |
| Atlas Copco AB 'A' | 9.850 | 316 | 0,04 |
| Atlas Copco AB 'B' | 13.413 | 386 | 0,04 |
| Brambles Ltd. | 35.589 | 322 | 0,04 |
| Caterpillar, Inc. | 2.457 | 335 | 0,04 |
| CIMIC Group Ltd. | 6.799 | 214 | 0,02 |
| ComfortDelGro Corp. Ltd. | 60.400 | 119 | 0,01 |
| CSX Corp. | 9.400 | 727 | 0,08 |
| Cummins, Inc. | 3.300 | 565 | 0,07 |
| Daikin Industries Ltd. | 600 | 79 | 0,01 |
| Dover Corp. | 8.382 | 840 | 0,10 |
| East Japan Railway Co. | 500 | 47 | 0,01 |
| Eaton Corp. PLC | 12.038 | 1.002 | 0,12 |
| Edenred | 292 | 15 | 0,00 |
| Emerson Electric Co. | 4.683 | 312 | 0,04 |
| Experian PLC | 11.891 | 361 | 0,04 |
| FedEx Corp. | 1.900 | 312 | 0,04 |
| Hochtief AG | 15 | 2 | 0,00 |
| Honeywell International, Inc. | 2.925 | 511 | 0,06 |
| Huntington Ingalls Industries, Inc. | 600 | 135 | 0,02 |
| Illinois Tool Works, Inc. | 1.200 | 181 | 0,02 |
| Ingersoll-Rand PLC | 702 | 89 | 0,01 |
| KION Group AG | 2.276 | 144 | 0,02 |
| ManpowerGroup, Inc. | 2.900 | 280 | 0,03 |
| Masco Corp. | 5.400 | 212 | 0,02 |
| Minebea Mitsumi, Inc. | 6.200 | 106 | 0,01 |
| Mitsubishi Heavy Industries Ltd. | 3.000 | 131 | 0,01 |
| Norfolk Southern Corp. | 3.000 | 598 | 0,07 |
| PACCAR, Inc. | 5.200 | 373 | 0,04 |
| Parker-Hannifin Corp. | 2.900 | 493 | 0,06 |
| Pentair PLC | 16.323 | 607 | 0,07 |
| Robert Half International, Inc. | 5.148 | 293 | 0,03 |
| Sandvik AB | 20.816 | 383 | 0,04 |
| SGS S.A. | 236 | 602 | 0,07 |
| Snap-on, Inc. | 3.201 | 530 | 0,06 |
| Societe BIC S.A. | 1.239 | 94 | 0,01 |
| Southwest Airlines Co. | 5.600 | 284 | 0,03 |
| Spirit AeroSystems Holdings, Inc. 'A' | 1.900 | 155 | 0,02 |
| Union Pacific Corp. | 3.998 | 676 | 0,08 |
| United Continental Holdings, Inc. (c) | 2.800 | 245 | 0,03 |
| United Parcel Service, Inc. 'B' | 3.000 | $ 310 | 0,04 |
| Volvo AB 'B' | 3.262 | 52 | 0,01 |
| WABCO Holdings, Inc. (c) | 25.449 | 3.375 | 0,39 |
| Waste Management, Inc. | 6.500 | 750 | 0,09 |
| West Japan Railway Co. | 2.800 | 227 | 0,03 |
| Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd. | 101.600 | 115 | 0,01 |
| | | 23.065 | 2,67 |

**INFORMATIONSTECHNOLOGIE**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Accenture PLC 'A' | 7.948 | 1.469 | 0,17 |
| Advantest Corp. | 6.800 | 187 | 0,02 |
| Apple, Inc. | 17.820 | 3.527 | 0,41 |
| Brother Industries Ltd. | 16.705 | 317 | 0,04 |
| Cadence Design Systems, Inc. (c) | 2.200 | 156 | 0,02 |
| Check Point Software Technologies Ltd. (c) | 3.000 | 347 | 0,04 |
| Cisco Systems, Inc. | 4.596 | 252 | 0,03 |
| Citrix Systems, Inc. | 4.230 | 415 | 0,05 |
| Cypress Semiconductor Corp. | 149.824 | 3.332 | 0,39 |
| DXC Technology Co. | 4.928 | 272 | 0,03 |
| Electronic Arts, Inc. (c) | 1.984 | 201 | 0,02 |
| F5 Networks, Inc. (c) | 420 | 61 | 0,01 |
| Fortinet, Inc. (c) | 3.000 | 230 | 0,03 |
| FUJIFILM Holdings Corp. | 9.200 | 467 | 0,05 |
| Hewlett Packard Enterprise Co. | 6.500 | 97 | 0,01 |
| HP, Inc. | 20.811 | 433 | 0,05 |
| Intel Corp. | 24.515 | 1.174 | 0,14 |
| International Business Machines Corp. | 5.179 | 714 | 0,08 |
| Intuit, Inc. | 1.048 | 274 | 0,03 |
| Juniper Networks, Inc. | 17.900 | 477 | 0,06 |
| Lam Research Corp. | 2.839 | 533 | 0,06 |
| Mastercard, Inc. 'A' | 5.371 | 1.421 | 0,17 |
| Micro Focus International PLC | 763 | 20 | 0,00 |
| Micron Technology, Inc. (c) | 13.850 | 534 | 0,06 |
| Microsoft Corp. | 31.445 | 4.212 | 0,49 |
| Motorola Solutions, Inc. | 700 | 117 | 0,01 |
| NetApp, Inc. | 3.949 | 244 | 0,03 |
| Nexon Co. Ltd. | 8.900 | 130 | 0,02 |
| NTT Data Corp. | 11.900 | 159 | 0,02 |
| Omron Corp. | 500 | 26 | 0,00 |
| Oracle Corp. | 28.275 | 1.611 | 0,19 |
| Oracle Corp. Japan | 3.862 | 283 | 0,03 |
| PayPal Holdings, Inc. (c) | 700 | 80 | 0,01 |
| QUALCOMM, Inc. | 2.100 | 160 | 0,02 |
| Red Hat, Inc. (c) | 22.937 | 4.307 | 0,50 |
| Renesas Electronics Corp. (c) | 5.300 | 26 | 0,00 |
| Sage Group PLC | 34.436 | 352 | 0,04 |
| SAP SE | 138 | 19 | 0,00 |
| Seagate Technology PLC | 3.647 | 172 | 0,02 |
| Texas Instruments, Inc. | 7.659 | 879 | 0,10 |
| Tokyo Electron Ltd. | 2.100 | 295 | 0,03 |
| Trend Micro, Inc. | 3.700 | 165 | 0,02 |
| Visa, Inc. 'A' | 11.061 | 1.920 | 0,22 |
| VMware, Inc. 'A' | 2.700 | 451 | 0,05 |
| Xerox Corp. | 2.500 | 88 | 0,01 |
| Zebra Technologies Corp. 'A' (c) | 100 | 21 | 0,00 |
| | | 32.627 | 3,78 |

**GRUNDSTOFFE**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Akzo Nobel NV | 2.070 | 195 | 0,02 |
| Anglo American PLC | 14.352 | 411 | 0,05 |
| Arkema S.A. | 2.263 | 211 | 0,02 |
| Berry Global Group, Inc. (c) | 3.543 | 186 | 0,02 |
| BHP Group PLC | 9.081 | 233 | 0,03 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| Celanese Corp. | 3.800 | $ | 410 | 0,05 |
| Covestro AG | 5.903 | | 301 | 0,03 |
| First Quantum Minerals Ltd. | 23.325 | | 222 | 0,03 |
| Fortescue Metals Group Ltd. | 11.123 | | 71 | 0,01 |
| Global Brass & Copper Holdings, Inc. | 43.526 | | 1.903 | 0,22 |
| Hitachi Chemical Co. Ltd. | 2.600 | | 71 | 0,01 |
| International Paper Co. | 9.322 | | 404 | 0,05 |
| Mondi PLC | 6.759 | | 154 | 0,02 |
| Nitto Denko Corp. | 4.500 | | 223 | 0,03 |
| Nucor Corp. | 3.000 | | 165 | 0,02 |
| Packaging Corp. of America | 3.000 | | 286 | 0,03 |
| Rio Tinto Ltd. | 7.156 | | 524 | 0,06 |
| Rio Tinto PLC | 5.113 | | 317 | 0,04 |
| Shin-Etsu Chemical Co. Ltd. | 3.300 | | 309 | 0,04 |
| Showa Denko KK | 3.600 | | 106 | 0,01 |
| Sumitomo Chemical Co. Ltd. | 62.888 | | 293 | 0,03 |
| Taiheiyo Cement Corp. | 400 | | 12 | 0,00 |
| Tosoh Corp. | 5.200 | | 73 | 0,01 |
| UPM-Kymmene Oyj | 13.848 | | 369 | 0,04 |
| Vale S.A. SP - ADR | 22.756 | | 306 | 0,03 |
| West Fraser Timber Co. Ltd. | 2.121 | | 97 | 0,01 |
| | | | 7.852 | 0,91 |
| **IMMOBILIEN** | | | | |
| Aroundtown S.A. | 31.893 | | 264 | 0,03 |
| Howard Hughes Corp. (c) | 2.005 | | 248 | 0,03 |
| Kerry Properties Ltd. | 6.500 | | 27 | 0,00 |
| New World Development Co. Ltd. | 244.052 | | 382 | 0,05 |
| Swire Properties Ltd. | 112.762 | | 456 | 0,05 |
| | | | 1.377 | 0,16 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| AES Corp. | 14.298 | | 240 | 0,03 |
| AGL Energy Ltd. | 4.313 | | 61 | 0,01 |
| CLP Holdings Ltd. | 22.281 | | 245 | 0,03 |
| Enagas S.A. | 11.418 | | 305 | 0,03 |
| Endesa S.A. | 25.862 | | 666 | 0,08 |
| Enel SpA | 114.821 | $ | 802 | 0,09 |
| Eneva S.A. (c)(h) | 2.322 | | 15 | 0,00 |
| Iberdrola S.A. | 37.122 | | 370 | 0,04 |
| Kansai Electric Power Co., Inc. | 13.800 | | 158 | 0,02 |
| ONE Gas, Inc. | 2.457 | | 222 | 0,03 |
| PPL Corp. | 14.900 | | 462 | 0,05 |
| Red Electrica Corp. S.A. | 7.693 | | 160 | 0,02 |
| Tohoku Electric Power Co., Inc. | 16.500 | | 167 | 0,02 |
| Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc. (c) | 31.788 | | 166 | 0,02 |
| UGI Corp. | 500 | | 27 | 0,00 |
| Verbund AG | 989 | | 52 | 0,01 |
| | | | 4.118 | 0,48 |
| | | | 161.488 | 18,72 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| Nationwide Building Society 10,250 % | 20.389 | | 3.928 | 0,45 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| Invesco Physical Gold ETC (f) | 133.374 | | 18.278 | 2,12 |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (f) | 1.247.968 | | 126.656 | 14,68 |
| | | | 144.934 | 16,80 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | | |
| Alexandria Real Estate Equities, Inc. | 10.748 | | 1.516 | 0,18 |
| American Tower Corp. | 11.574 | | 2.366 | 0,27 |
| Apartment Investment & Management Co. | 33.076 | | 1.658 | 0,19 |
| CapitaLand Mall Trust | 10.200 | | 20 | 0,00 |
| Dexus | 4.265 | | 39 | 0,00 |
| Duke Realty Corp. | 53.064 | | 1.677 | 0,19 |
| Empire State Realty Trust, Inc. 'A' | 9.017 | | 134 | 0,02 |
| Equinix, Inc. | 3.778 | $ | 1.905 | 0,22 |
| Equity Residential | 22.807 | | 1.731 | 0,20 |
| Invitation Homes, Inc. | 37.448 | | 1.001 | 0,12 |
| Kimco Realty Corp. | 1.800 | | 33 | 0,00 |
| Life Storage, Inc. | 1.338 | | 127 | 0,01 |
| Link REIT | 54.018 | | 665 | 0,08 |
| Mid-America Apartment Communities, Inc. | 2.374 | | 280 | 0,03 |
| RioCan Real Estate Investment Trust | 45.839 | | 912 | 0,11 |
| Scentre Group | 116.147 | | 313 | 0,04 |
| Segro PLC | 46.112 | | 429 | 0,05 |
| Simon Property Group, Inc. | 20.122 | | 3.215 | 0,37 |
| SmartCentres Real Estate Investment Trust | 15.300 | | 389 | 0,05 |
| Sun Communities, Inc. | 12.897 | | 1.653 | 0,19 |
| Sunstone Hotel Investors, Inc. | 10.224 | | 140 | 0,02 |
| Urban Edge Properties | 6.556 | | 114 | 0,01 |
| Ventas, Inc. | 22.269 | | 1.522 | 0,18 |
| | | | 21.839 | 2,53 |

| | PAR (000S) | | |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (j)** | | | |
| | | 921 | 0,11 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 921 | 0,11 |

| | AKTIEN | | | |
|---|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | 732 | | 7.335 | 0,85 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$** | **1.353.099** | **156,86** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 23 | $ (28) | 0,00 |
| CAC 40 Index July Futures | Short | 07/2019 | 1 | (2) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 113,800 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[(1)] | Long | 08/2019 | 1.966 | (1) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 134,500 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[(1)] | Short | 08/2019 | 172 | (5) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 153,000 EUR auf Euro-BTP 10-Year Bond September 2019 Futures[(1)] | Long | 08/2019 | 233 | 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[(1)] | Short | 07/2019 | 67 | (167) | (0,02) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[(1)] | Short | 07/2019 | 69 | (140) | (0,02) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 178,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2019 Futures[(1)] | Long | 08/2019 | 468 | 0 | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 1 | 0 | 0,00 |
| DAX Index September Futures | Long | 09/2019 | 1 | 9 | 0,00 |
| E-mini NASDAQ 100 Index September Futures | Long | 09/2019 | 131 | 8 | 0,00 |
| E-mini Russell 2000 Index September Futures | Short | 09/2019 | 15 | (22) | 0,00 |
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Long | 09/2019 | 1.133 | 2.324 | 0,27 |
| Euro STOXX 50 September Futures | Short | 09/2019 | 707 | (635) | (0,07) |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09/2019 | 58 | (9) | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2019 | 235 | (1.419) | (0,17) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 1.134 | 2.955 | 0,34 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 105 | (582) | (0,07) |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 481 | (1.841) | (0,21) |

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09/2019 | 1.966 | $ (368) | (0,04) |
| FTSE 100 Index September Futures | Long | 09/2019 | 140 | 152 | 0,02 |
| FTSE/MIB Index September Futures | Long | 09/2019 | 1 | 4 | 0,00 |
| Hang Seng China Enterprises Index July Futures | Long | 07/2019 | 43 | (4) | 0,00 |
| IBEX 35 Index July Futures | Long | 07/2019 | 1 | 1 | 0,00 |
| IXAIXA Index September Futures | Short | 09/2019 | 2 | (4) | 0,00 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 7 | 4 | 0,00 |
| JPX Nikkei Index 400 September Futures | Short | 09/2019 | 37 | (4) | 0,00 |
| Mini MSCI EAFE Index September Futures | Long | 09/2019 | 445 | 1.064 | 0,12 |
| Mini MSCI Emerging Markets Index September Futures | Short | 09/2019 | 551 | (392) | (0,05) |
| Nikkei 225 Index September Futures | Long | 09/2019 | 10 | 10 | 0,00 |
| OBX Index July Futures | Short | 07/2019 | 1 | 0 | 0,00 |
| OMX Stockholm 30 Index July Futures | Short | 07/2019 | 1 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 112,100 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 376 | 19 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 129,500 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 450 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 129,750 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 11 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 154,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 1.000 | (1) | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 154,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 323 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 156,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 148 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 159,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 40 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 67 | 75 | 0,01 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 69 | 68 | 0,01 |
| S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures | Long | 09/2019 | 51 | 20 | 0,00 |
| SPI 200 Index September Futures | Short | 09/2019 | 42 | (43) | (0,01) |
| Swiss Market Index September Futures | Long | 09/2019 | 95 | (88) | (0,01) |
| Topix Index September Futures | Long | 09/2019 | 126 | (7) | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 2.016 | (2.874) | (0,33) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1.036 | 1.008 | 0,12 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Long | 09/2019 | 6 | 1 | 0,00 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 144 | 262 | 0,03 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09/2019 | 41 | (98) | (0,01) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 2 | (1) | 0,00 |
| | | | | $ (751) | (0,09) |

[1] Future-Style-Option.

**OPTIONSKAUF**

**VERKAUFSOPTIONEN OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | $ 125,500 | 23.08.2019 | 76 | $ 1 | $ 1 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 125,750 | 23.08.2019 | 49 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,250 | 23.08.2019 | 1.713 | 15 | 2 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 111,500 | 23.08.2019 | 292 | 2 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,500 | 23.08.2019 | 378 | 3 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 114,000 | 23.08.2019 | 388 | 3 | 1 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | 230,000 | 23.08.2019 | 76 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 25 | $ 4 | 0,00 |

**OPTIONEN AUF INDIZES**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT EURO STOXX 50 | $ 3.250,000 | 19.07.2019 | 442 | $ 195 | $ 19 | 0,00 |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.900,000 | 19.07.2019 | 29 | 104 | 65 | 0,01 |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.800,000 | 20.09.2019 | 69 | 759 | 261 | 0,03 |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.600,000 | 20.12.2019 | 61 | 738 | 228 | 0,03 |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.700,000 | 20.03.2020 | 61 | 754 | 462 | 0,05 |
| | | | | $ 2.550 | $ 1.035 | 0,12 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 129,000 | 26.07.2019 | 89 | $ (22) | $ (24) | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

## OPTIONEN AUF INDIZES

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT EURO STOXX 50 | $ 3.150,000 | 19.07.2019 | 442 | $ (94) | $ (9) | 0,00 |
| Call - CBOT EURO STOXX 50 | 3.450,000 | 19.07.2019 | 442 | (91) | (269) | (0,03) |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.825,000 | 19.07.2019 | 29 | (53) | (30) | 0,00 |
| Call - CBOT S&P 500 | 2.975,000 | 19.07.2019 | 29 | (57) | (61) | (0,01) |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.700,000 | 20.09.2019 | 69 | (607) | (160) | (0,02) |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.500,000 | 20.12.2019 | 61 | (573) | (163) | (0,02) |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.600,000 | 20.03.2020 | 61 | (598) | (354) | (0,04) |
| | | | | $ (2.073) | $ (1.046) | (0,12) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (782)** | **(0,09)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Altria Group, Inc. | (1,000) % | 20.06.2021 | $ 1.210 | $ 16 | 0,00 |
| Boston Scientific Corp. | (1,000) | 20.06.2020 | 1.800 | 30 | 0,01 |
| Cigna Corp. | (1,000) | 20.03.2021 | 370 | 5 | 0,00 |
| Kraft Heinz Foods Co. | (1,000) | 20.09.2020 | 1.000 | 13 | 0,00 |
| | | | | $ 64 | 0,01 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Daimler AG | 1,000 % | 20.12.2020 | € 1.010 | $ (2) | 0,00 |
| Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2019 | 300 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ (2) | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-32 5-Year Index | (1,000) % | 20.06.2024 | $ 85.100 | $ (224) | (0,03) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 25.200 | $ 61 | 0,01 |

## 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 | 2,000 % | 15.12.2047 | $ 7.140 | $ (52) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,428 | 20.12.2047 | 1.400 | (146) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,478 | 20.12.2047 | 1.136 | (137) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,499 | 20.12.2047 | 5.400 | (650) | (0,08) |
| Erhalt | 3-Month NZD-BBR | 3,250 | 21.03.2028 | NZD 600 | (57) | (0,01) |
| Zahlung[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,843 | 24.02.2025 | $ 41.550 | 215 | 0,03 |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,849 | 24.02.2025 | 41.550 | (226 | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 12.600 | (1.177) | (0,14) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,400 | 07.12.2026 | 14.100 | (479) | (0,06) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 7.950 | 1.263 | 0,15 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2028 | 11.540 | 775 | 0,09 |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 3,100 | 17.04.2028 | 43.760 | (1.895) | (0,22) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 3,134 | 13.09.2028 | 42.700 | (1.938) | (0,22) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | € 32.640 | 150 | 0,02 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.09.2021 | £ 50.200 | (396) | (0,05) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 2,340 | 13.01.2026 | 7.580 | (399) | (0,05) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,380 | 18.06.2028 | ¥ 1.379.000 | 328 | 0,04 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 | 20.03.2024 | 2.017.000 | 45 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 1,500 | 20.12.2044 | 990.000 | 2.006 | 0,23 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,323 | 15.03.2029 | € 2.950 | 88 | 0,01 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,535 | 15.03.2028 | 780 | 44 | 0,01 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,946 | 15.03.2048 | 2.065 | 511 | 0,06 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,954 | 03.06.2029 | $ 8.750 | 26 | 0,00 |

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | CPURNSA | 1,550 % | 26.07.2021 | $ 3.100 | $ (42) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,603 | 12.09.2021 | 2.470 | (35) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,678 | 24.05.2021 | 11.600 | 19 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,845 | 24.05.2026 | 2.900 | 32 | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,955 | 25.07.2024 | 15.600 | (42) | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,080 | 25.07.2027 | 6.700 | 100 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,102 | 20.07.2027 | 9.900 | 173 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,122 | 01.08.2027 | 6.800 | 129 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,150 | 25.09.2027 | 3.300 | 65 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,155 | 17.10.2027 | 3.700 | 77 | 0,01 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,168 | 15.07.2020 | 3.400 | (19) | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,180 | 20.09.2027 | 3.340 | 78 | 0,01 |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,000 | 15.04.2020 | € 470 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,160 | 15.08.2020 | 14.320 | (153) | (0,02) |
| Erhalt | FRCPXTOB | 1,590 | 15.02.2028 | 5.500 | 393 | 0,05 |
| Erhalt | FRCPXTOB | 1,910 | 15.01.2038 | 1.010 | 174 | 0,02 |
| Erhalt | UKRPI | 3,100 | 15.06.2031 | £ 100 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,350 | 15.05.2030 | 4.200 | (55) | (0,01) |
| Erhalt | UKRPI | 3,525 | 15.09.2028 | 5.500 | (14) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,530 | 15.10.2031 | 10 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,579 | 15.10.2033 | 10.820 | (17) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,580 | 15.06.2039 | 740 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,590 | 15.06.2039 | 820 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,593 | 15.11.2028 | 3.500 | 32 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,595 | 15.11.2028 | 1.830 | 18 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,600 | 15.06.2039 | 2.890 | 21 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,718 | 15.12.2028 | 2.800 | 81 | 0,01 |
| | | | | | $ (1.089) | (0,13) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (1.190)** | **(0,14)** |

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

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**BARRIER-OPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Barrierewert | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYI | Put - OTC S&P 500 U&I @ 2.683,000 | 10Y USISDA 2,677 | $ 2.683 | 20.03.2020 | 5.926 | $ 36 | $ 26 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Kauf | 1,650 % | 21.08.2019 | 48.000 | $ 5 | $ 1 | 0,00 |

**DEVISENOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Call - OTC USD versus INR | INR 80,500 | 18.10.2019 | 16.421 | $ 145 | $ 2 | 0,00 |

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 5,500 % | 24.08.2021 | 111.000 | $ 4.395 | $ 14 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 5,500 | 24.08.2021 | 89.200 | 3.796 | 12 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 8.191 | $ 26 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

## OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FAR | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | $ 73,000 | 08.07.2019 | 46.400 | $ 2 | $ 0 | 0,00 |
| JPM | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 70,000 | 08.07.2019 | 24.800 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 71,000 | 08.07.2019 | 42.700 | 1 | 0 | 0,00 |
| SAL | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 73,000 | 08.07.2019 | 48.300 | 2 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 74,500 | 08.07.2019 | 72.700 | 3 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 9 | $ 0 | 0,00 |

## STRADDLE-OPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call & Put - OTC 1-Year vs. 30-Year Forward Volatility Agreement | 0,000 % | 13.02.2020 | 16.800 | $ 1.682 | $ 1.657 | 0,19 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850% | 17.07.2019 | 4.600 | $ (4) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 3.400 | (4) | (1) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 3.800 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 5.600 | (9) | (1) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 8.900 | (19) | (3) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 3.500 | (4) | (1) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 2.000 | (3) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 3.300 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 3.500 | (5) | (1) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 3.800 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 1.600 | (2) | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 4.500 | (8) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 6.700 | (7) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 4.900 | (6) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 1.400 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 3.900 | (6) | (1 | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 1.900 | (3) | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 3.300 | (3) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (97) | $ (15) | 0,00 |

## DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Put - OTC USD versus INR | INR 71,500 | 18.10.2019 | 8.210 | $ (140) | $ (221) | (0,03) |

## INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | 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) | $ (14) | 0,00 |
| JPM | Cap - OTC CPURNSA | 234,781 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 4,000 %] oder 0 | 16.05.2024 | 1.500 | (11) | 0 | 0,00 |
| | Cap - OTC YOY CPURNSA | 233,707 | Maximal [(3 + 0,000 %) - (Index Final/Index Initial)] oder 0 | 10.04.2020 | 10.600 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Floor - OTC YOY CPURNSA | 233,707 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 10.04.2020 | 10.600 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Floor - OTC YOY CPURNSA | 234,812 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 24.03.2020 | 14.000 | (158) | 0 | 0,00 |
| | Floor - OTC YOY CPURNSA | 238,654 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 02.10.2020 | 7.000 | (129) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | $ (672) | $ (17) | 0,00 |

## ZINSCAPS

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor[2] | 10-Year USD-ISDA - 2-Year USD-ISDA | 0,000 % | 02.01.2020 | 117.300 | $ (91) | $ (13) | 0,00 |

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

(2) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Mexico Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 2.900 | $ 28 | $ (29) | $ (1) | 0,00 |
| BPS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 4.100 | 40 | (41) | (1) | 0,00 |
| BRC | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 4.600 | 39 | (40) | (1) | 0,00 |
| GST | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 2.300 | 20 | (21) | (1) | 0,00 |
| HUS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 2.800 | 25 | (25) | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 152 | $ (156) | $ (4) | 0,00 |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Deutsche Bank AG | 1,000 % | 20.12.2021 | € 700 | $ (146) | $ 110 | $ (36) | (0,01) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17.11.2059 | $ 2.900 | $ (86) | $ 109 | $ 23 | 0,00 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 12.200 | (403) | 501 | 98 | 0,01 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 2.200 | (5) | 2 | (3) | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 5.100 | (148) | 189 | 41 | 0,01 |
| | | | | | $ (642) | $ 801 | $ 159 | 0,02 |

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

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

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

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 % | 20.06.2028 | ILS 3.610 | $ 0 | $ 55 | $ 55 | 0,01 |
| BRC | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,374) | 20.06.2020 | 14.910 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,950 | 20.06.2028 | 3.210 | 0 | 45 | 45 | 0,01 |
| DUB | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,414) | 20.06.2020 | 14.260 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| GLM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | 11.560 | 1 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,290) | 16.02.2020 | 27.870 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,270) | 21.03.2020 | 17.230 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,971 | 16.02.2028 | 5.870 | 0 | 99 | 99 | 0,01 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 2.470 | 0 | 37 | 37 | 0,00 |
| HUS | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | 9.100 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 1.940 | 0 | 29 | 29 | 0,00 |
| JPM | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 2,078 | 20.06.2028 | 3.040 | 0 | 52 | 52 | 0,01 |
| MYC | Erhalt | CPURNSA | (1,810) | 19.07.2026 | $ 1.500 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | Erhalt | CPURNSA | (1,805) | 20.09.2026 | 26.000 | 0 | (325) | (325) | (0,04) |
| | Erhalt | CPURNSA | (1,800) | 20.07.2026 | 3.800 | 0 | (53) | (53) | (0,01) |
| | | | | | | $ 1 | $ (101) | $ (100) | (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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | SPSIBITR Index | 22 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | $ 148 | 15.01.2020 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| BPS | Zahlung | DWRTFT Index | 610 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 6.824 | 13.02.2020 | 0 | 188 | 188 | 0,02 |
| | Zahlung | DWRTFT Index | 1.217 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 13.074 | 22.04.2020 | 0 | (151) | (151) | (0,02) |
| | Erhalt | NDUEEGF Index | 143.575 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 70.614 | 17.06.2020 | 0 | 79 | 79 | 0,01 |
| FAR | Erhalt | AMZX Index | 1.014 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.265 | 12.09.2019 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| FBF | Erhalt | LNG Index | 55.124 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.766 | 15.06.2020 | 0 | 6 | 6 | 0,00 |
| JPM | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 33.500 | 20.09.2019 | 130 | (3.033) | (2.903) | (0,33) |
| | Zahlung | DWRTFT Index | 77 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 827 | 06.11.2019 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| MEI | Erhalt | KOSPI2 Index | 250.000 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | KRW 67.479 | 11.09.2019 | 0 | 2 | 2 | 0,00 |
| MYI | Erhalt | NDUEACWF Index | 3.196 | 3-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | $ 800 | 14.08.2019 | 0 | 26 | 26 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 130 | $ (2.900) | $ (2.770) | (0,32) |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

## 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 | Apache Corp. | 4.804 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | $ 134 | 15.11.2019 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | 0,00 |
| | Zahlung | Norfolk Southern Corp. | 1.601 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 305 | 15.11.2019 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | Zahlung | NVR, Inc. | 74 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 254 | 15.11.2019 | 0 | 5 | 5 | 0,00 |
| | Erhalt | Plains All American Pipeline LP | 5.776 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 136 | 15.11.2019 | 0 | 4 | 4 | 0,00 |
| | Zahlung | BHP Group Ltd. | 2.424 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 133 | 16.03.2020 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | Zahlung | Rio Tinto PLC | 2.275 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 138 | 16.03.2020 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Zahlung | Dunkin' Brands Group, Inc. | 1.590 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 128 | 15.06.2020 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Zahlung | Welltower, Inc. | 1.542 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 129 | 15.06.2020 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| BPS | Zahlung | Starwood Property Trust, Inc. | 7.544 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 166 | 30.08.2019 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| FAR | Erhalt | Phillips 66 Partners LP | 4.774 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 237 | 31.01.2020 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| FBF | Erhalt | Energy Transfer LP | 230.351 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.273 | 15.06.2020 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | Erhalt | Enterprise Products Partners LP | 136.683 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 4.006 | 15.06.2020 | 0 | (62) | (62) | (0,01) |
| | Erhalt | ONEOK, Inc. | 66.957 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 4.506 | 15.06.2020 | 0 | 100 | 100 | 0,01 |
| | Erhalt | Plains All American Pipeline LP | 157.474 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.797 | 15.06.2020 | 0 | 36 | 36 | 0,00 |
| GST | Zahlung | UBS Group AG | 14.117 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | CHF 163 | 27.05.2020 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Zahlung | Exxon Mobil Corp. | 2.363 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 177 | 15.11.2019 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Zahlung | Amgen, Inc. | 589 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 105 | 15.05.2020 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| JPM | Zahlung | Iron Mountain, Inc. | 6.566 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 213 | 15.01.2020 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| MYI | Zahlung | International Business Machines Corp. | 1.447 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 195 | 15.11.2019 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Zahlung | Southern Co. | 3.935 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 218 | 15.11.2019 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Zahlung | Wells Fargo & Co. | 4.020 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 178 | 15.11.2019 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | Zahlung | Plains All American Pipeline LP | 543 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 128 | 27.05.2020 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Zahlung | U.S. Bancorp | 3.242 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 162 | 27.05.2020 | (0) | (8) | (8) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (0) | $ (12) | $ (12) | 0,00 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CAD | 10.854 | $ | 8.237 | $ 0 | $ (69) | $ (69) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 6.843 | CHF | 6.864 | 197 | 0 | 197 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 868 | £ | 683 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 7.482 | CAD | 9.834 | 49 | 0 | 49 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 123 | ILS | 440 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 31.290 | $ | 4.803 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 7.212 | | 9.194 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 07/2019 | IDR | 12.292.616 | | 849 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 309.700 | | 2.897 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07/2019 | KRW | 1.030.325 | | 893 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | MXN | 16.832 | | 875 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 11.393 | | 1.948 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 472 | ARS | 23.745 | 65 | 0 | 65 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 463 | € | 413 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 49.543 | £ | 39.061 | 170 | 0 | 170 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 867 | IDR | 12.292.616 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 891 | KRW | 1.030.325 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 872 | MXN | 16.832 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.143 | RUB | 135.275 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.163 | TRY | 12.919 | 57 | 0 | 57 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 868 | ZAR | 12.431 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | £ | 39.061 | $ | 49.619 | $ 0 | $ (171) | $ (171) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ | 755 | ARS | 33.677 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | | 519 | MXN | 10.340 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 52.270 | $ | 8.037 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 10.340 | | 513 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | CLP | 583.817 | | 827 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 40.062 | | 44.804 | 0 | (819) | (819) | (0,10) |
| | 08/2019 | MXN | 77.511 | | 3.901 | 0 | (105) | (105) | (0,01) |
| | 10/2019 | $ | 5.043 | INR | 370.431 | 248 | 0 | 248 | 0,03 |
| | 10/2019 | | 523 | MXN | 10.340 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 1.592 | $ | 1.108 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 5.029 | | 5.686 | 0 | (41) | (41) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 297.600 | | 2.776 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.202 | ARS | 58.578 | 123 | 0 | 123 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 901 | CAD | 1.194 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 51.607 | € | 45.409 | 104 | 0 | 104 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 12.875 | £ | 10.124 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 25.387 | ¥ | 2.765.124 | 279 | 0 | 279 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 1.528 | ZAR | 22.247 | 48 | 0 | 48 | 0,01 |
| | 08/2019 | € | 45.409 | $ | 51.739 | 0 | (105) | (105) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 358 | PHP | 18.741 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 24.760 | $ | 3.800 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 10.265 | | 3.038 | 0 | (69) | (69) | (0,01) |
| FBF | 09/2019 | $ | 3.675 | INR | 258.007 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | BRL | 9.922 | $ | 2.526 | 0 | (61) | (61) | (0,01) |
| | 07/2019 | CLP | 571.948 | | 824 | 0 | (18) | (18) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 1.345 | | 1.526 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 3.399 | | 4.327 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | IDR | 12.273.520 | | 859 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 851 | BRL | 3.289 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 584 | CLP | 396.705 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 894 | MXN | 17.050 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 8.338 | IDR | 122.360.313 | 241 | 0 | 241 | 0,03 |
| | 12/2019 | CLP | 396.705 | $ | 584 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | ARS | 117.216 | | 2.362 | 0 | (289) | (289) | (0,03) |
| | 07/2019 | BRL | 3.289 | | 851 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 6.864 | | 7.025 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07/2019 | CLP | 1.561.798 | | 2.275 | 2 | (28) | (26) | 0,00 |
| | 07/2019 | | €659 | | 750 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | IDR | 12.376.812 | | 866 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07/2019 | KRW | 1.030.325 | | 891 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | THB | 53.742 | | 1.736 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 800 | ARS | 39.720 | 100 | 0 | 100 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 858 | BRL | 3.289 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 7.628 | CAD | 10.283 | 241 | 0 | 241 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 862 | CLP | 583.817 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.740 | KRW | 2.059.616 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.620 | MXN | 50.787 | 23 | (2) | 21 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.143 | ZAR | 30.696 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 257.200 | $ | 2.392 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 7.046 | CHF | 6.864 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 30 | $ | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 11.234 | HKD | 87.729 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 2.143 | IDR | 30.539.893 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 3.395 | INR | 237.755 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 116.695 | $ | 3.728 | 0 | (64) | (64) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | £ | 10.056 | | 12.692 | 0 | (106) | (106) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 215.100 | | 1.991 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.143 | COP | 6.852.135 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.118 | DKK | 13.944 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 694 | € | 614 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 859 | KRW | 1.016.003 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.890 | RUB | 188.491 | 93 | 0 | 93 | 0,01 |
| | 09/2019 | THB | 12.543 | $ | 396 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 10/2019 | INR | 370.935 | | 5.043 | 0 | (254) | (254) | (0,03) |
| | 11/2019 | TWD | 37.495 | | 1.195 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| MSB | 09/2019 | $ | 2.037 | RUB | 134.806 | 77 | 0 | 77 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | £ | 11.020 | $ | 13.929 | 0 | (96) | (96) | (0,01) |
| RBC | 07/2019 | CAD | 623 | | 465 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | COP | 6.852.135 | | 2.155 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 2.146 | COP | 6.852.135 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | CLP | 590.997 | $ | 864 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.870 | BRL | 7.147 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08/2019 | BRL | 7.147 | $ | 1.864 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 7.147 | | 1.773 | 0 | (92) | (92) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 18.181 | | 23.011 | 0 | (127) | (127) | (0,02) |
| | 09/2019 | KRW | 11.695.832 | | 9.825 | 0 | (301) | (301) | (0,04) |
| | 09/2019 | SGD | 691 | | 507 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 46.784 | | 1.495 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | IDR | 12.307.901 | | 860 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.421 | TRY | 8.353 | 13 | (2) | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 868 | ZAR | 12.674 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | IDR | 12.292.616 | $ | 867 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Global Multi-Asset Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | $ | 869 | IDR | 12.292.616 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 19.980 | $ | 2.552 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| TOR | 09/2019 | $ | 7.649 | COP | 25.855.846 | 372 | 0 | 372 | 0,04 |
| UAG | 07/2019 | ¥ | 1.942.724 | $ | 18.050 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 18.092 | ¥ | 1.942.724 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 5.062 | $ | 730 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09/2019 | MYR | 1.109 | | 267 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 2.873 | $ (3.184) | $ (311) | (0,04) |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2019 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 | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CHF | 6.221 | $ | 6.202 | $ 0 | $ (178) | $ (178) | (0,02) |
| | 07/2019 | € | 124.243 | | 141.190 | 0 | (298) | (298) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 5.078 | AUD | 7.272 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 7.310 | CAD | 9.615 | 48 | 0 | 48 | 0,01 |
| | 07/2019 | ZAR | 9.666 | $ | 658 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 7.272 | | 5.084 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 9.615 | | 7.315 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 141.550 | € | 124.243 | 300 | 0 | 300 | 0,03 |
| BPS | 07/2019 | € | 91.787 | $ | 104.344 | 0 | (183) | (183) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 472 | € | 419 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 12.991 | £ | 10.242 | 45 | 0 | 45 | 0,01 |
| | 08/2019 | £ | 10.242 | $ | 13.011 | 0 | (45) | (45) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 102.409 | € | 89.840 | 163 | 0 | 163 | 0,02 |
| | 09/2019 | KRW | 4.481.763 | $ | 3.780 | 0 | (100) | (100) | (0,01) |
| BRC | 07/2019 | $ | 135.726 | € | 121.359 | 2.477 | 0 | 2.477 | 0,29 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 7.272 | $ | 5.034 | 0 | (69) | (69) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 126.747 | | 144.057 | 4 | (286) | (282) | (0,03) |
| | 07/2019 | ¥ | 1.850.845 | | 16.989 | 0 | (190) | (190) | (0,02) |
| | 07/2019 | TRY | 643 | | 110 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.262 | DKK | 8.295 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 758 | € | 668 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 875 | NOK | 7.443 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | NOK | 7.443 | $ | 876 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 141.562 | € | 124.243 | 287 | 0 | 287 | 0,03 |
| | 10/2019 | DKK | 8.295 | $ | 1.271 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| DUB | 09/2019 | PHP | 29.411 | | 564 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 4.251 | | 4.744 | 0 | (97) | (97) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 512 | € | 456 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 23.718 | $ | 1.220 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 9.615 | | 7.133 | 0 | (225) | (225) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 6.367 | CHF | 6.221 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 8.566 | HKD | 66.933 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 9.666 | $ | 663 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 08/2019 | CHF | 6.221 | | 6.386 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08/2019 | HKD | 66.933 | | 8.567 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 1.379 | | 1.009 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 67.796 | | 2.166 | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| IND | 07/2019 | SEK | 17.490 | | 1.825 | 0 | (60) | (60) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | DKK | 8.295 | | 1.260 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09/2019 | INR | 197.520 | | 2.796 | 0 | (37) | (37) | (0,01) |
| | 11/2019 | TWD | 49.163 | | 1.569 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | $ | 125.533 | € | 112.264 | 2.313 | 0 | 2.313 | 0,27 |
| RBC | 07/2019 | € | 2.590 | $ | 2.938 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | $ | 2.181 | BRL | 8.337 | 0 | (6) | (6 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.868 | € | 1.652 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08/2019 | BRL | 8.337 | $ | 2.175 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 8.337 | | 2.068 | 0 | (107) | (107) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 9.034 | | 10.135 | 0 | (152) | (152) | (0,02) |
| | 07/2019 | £ | 10.242 | | 12.964 | 0 | (72) | (72) | (0,01) |
| | 07/2019 | NOK | 7.443 | | 851 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 41.998 | | 638 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 467 | € | 413 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.886 | SEK | 17.490 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 9.666 | $ | 663 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 17.490 | | 1.890 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR | 13.416.480 | | 916 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | ILS | 812 | | 224 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | PLN | 2.258 | | 600 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | HKD | 66.933 | | 8.545 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 256 | € | 226 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 135.705 | | 121.359 | 2.499 | 0 | 2.499 | 0,29 |
| UAG | 07/2019 | | 17.196 | ¥ | 1.850.845 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 1.850.845 | $ | 17.236 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 09/2019 | MYR | 3.163 | | 761 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | | | | | | $ 8.240 | $ (2.502) | $ 5.738 | 0,67 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | CHF | 79 | $ | 79 | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 68 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 59 | AUD | 84 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 90 | CAD | 118 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 146 | $ | 10 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 84 | | 59 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 118 | | 90 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 1.322 | | 1.677 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6 | DKK | 38 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.644 | £ | 1.294 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 59.797 | $ | 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € | 259 | | 290 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 84 | | 58 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 1.321 | | 1.679 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 25.566 | | 235 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 10 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 294 | € | 259 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.609 | £ | 1.270 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2 | TRY | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 259 | $ | 295 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | TRY | 11 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.637 | £ | 1.286 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2 | TRY | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | £ | 112 | $ | 142 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 4 | RUB | 282 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 394 | $ | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 118 | | 87 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 81 | CHF | 79 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 23 | £ | 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 146 | $ | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | CHF | 79 | | 81 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 25 | | 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 689 | | 22 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| IND | 07/2019 | SEK | 251 | | 26 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | TRY | 21 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | INR | 2.279 | | 32 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 501 | | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | DKK | 153 | | 23 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 26 | BRL | 99 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | BRL | 99 | $ | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 99 | | 25 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | RUB | 1.125 | | 17 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.607 | £ | 1.270 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 26 | ¥ | 2.796 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 27 | SEK | 251 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 146 | $ | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 251 | | 27 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR | 183.862 | | 13 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | ILS | 33 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | $ | 1.576 | £ | 1.247 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 858 | $ | 110 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 08/2019 | $ | 5 | MXN | 97 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | TRY | 42 | $ | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 212 | ¥ | 22.770 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 8 | ZAR | 110 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 22.770 | $ | 212 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | MYR | 39 | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 38 | $ (33) | $ 5 | 0,00 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 4.115** | **0,48** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 77.800 | $ (78.406) | (9,09) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (78.406)** | **(9,09)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 1.276.836** | **148,02** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (414.239)** | **(48,02)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 862.597** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(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 | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Dommo Energia S.A. | 26.12.2017 | $ 20 | $ 54 | 0,01 |
| Eneva S.A. | 25.03.2019 | 11 | 15 | 0,00 |
| | | $ 31 | $ 69 | 0,01 |

**(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 141.415 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 3.889 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Aktienoptionsgeschäfte regeln, verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 3.276 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 24.109 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 4.300 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 921 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | $ (942) | $ 921 | $ 921 | 0,11 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (942)** | **$ 921** | **$ 921** | **0,11** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 455.566 | $ 897.479 | $ 54 | $ 1.353.099 |
| Finanzderivate[3] | (771) | 2.914 | 0 | 2.143 |
| Leerverkäufe | 0 | (78.406) | 0 | (78.406) |
| **Summen** | **$ 454.795** | **$ 821.987** | **$ 54** | **$ 1.276.836** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 496.682 | $ 984.346 | $ 203 | $ 1.481.231 |
| Finanzderivate[3] | (16.644) | 6.161 | 0 | (10.483) |
| Leerverkäufe | 0 | (67.065) | 0 | (67.065) |
| **Summen** | **$ 480.038** | **$ 923.442** | **$ 203** | **$ 1.403.683** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | (0,370) % | 17.04.2019 | 02.07.2019 | € (1.122) | $ (1.277) | (0,15) |
| | (0,300) | 17.04.2019 | 18.07.2019 | (8.000) | (9.105) | (1,06) |
| GRE | 2,610 | 30.04.2019 | 22.07.2019 | $ (3.437) | (3.453) | (0,40) |
| IND | 0,870 | 11.06.2019 | 09.08.2019 | £ (10.124) | (12.891) | (1,49) |
| | 2,560 | 09.05.2019 | 07.08.2019 | $ (86.729) | (87.056) | (10,09) |
| | 2,560 | 15.05.2019 | 07.08.2019 | (4.359) | (4.373) | (0,51) |
| | 2,590 | 31.05.2019 | 12.07.2019 | (13.374) | (13.403) | (1,55) |
| | 2,600 | 06.06.2019 | 18.07.2019 | (6.844) | (6.857) | (0,80) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (138.415)** | **(16,05)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 1.657 | $ 0 | $ 1.657 |
| BPS | 126 | (380) | (254) |
| BRC | 1.588 | (1.450) | 138 |
| CBK | 114 | 0 | 114 |
| CKL | (1) | 0 | (1) |
| DUB | (14) | (10) | (24) |
| FAR | (8) | 0 | (8) |
| FBF | 74 | 50 | 124 |
| GLM | 172 | (430) | (258) |
| GST | 12 | 0 | 12 |
| HUS | (244) | 0 | (244) |
| IND | (61) | 0 | (61) |
| JPM | (3.238) | 2.770 | (468) |
| MEI | 2 | (10) | (8) |
| MSB | 77 | 0 | 77 |
| MYC | (301) | 265 | (36) |
| MYI | 2.246 | (2.410) | (164) |
| RBC | (24) | 0 | (24) |
| RYL | 4 | 0 | 4 |
| SAL | (3 | 0 | (3) |
| SCX | (967) | 1.000 | 33 |
| SOG | 19 | 0 | 19 |
| SSB | (16) | 0 | (16) |
| TOR | 2.871 | (2.960) | (89) |
| UAG | 30 | 0 | 30 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 122,80 | 90,46 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 33,95 | 83,72 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,11 | 0,00 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,09) | (1,79) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,14) | 0,59 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,48 | (0,03) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (9,09) | (7,89) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (16,05) | (31,84) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0,00 | (0,29) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 12,04 | 11,39 |
| US-Regierungsbehörden | 43,47 | 46,23 |
| US-Schatzobligationen | 20,08 | 34,29 |
| Non-Agency-MBS | 1,28 | 0,57 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 5,77 | 6,08 |
| Staatsemissionen | 15,79 | 7,49 |
| Investmentfonds | 18,97 | 18,03 |
| Stammaktien | 18,72 | 19,02 |
| Vorzugswertpapiere | 0,45 | 0,44 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 16,80 | 22,20 |
| Real Estate Investment Trusts | 2,53 | 2,16 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,11 | 3,75 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,85 | 2,53 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,09) | (1,92) |
| Optionskauf | | |
| Optionen auf Indizes | 0,12 | 0,70 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | (0,03) |
| Optionen auf Indizes | (0,12) | (0,54) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | 0,01 | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,03) | 0,37 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,13) | 0,21 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Barrier-Optionen | 0,01 | 0,00 |
| Zinsswapoption | 0,00 | 0,04 |
| Gekaufte Optionen Straddle-Optionen | 0,19 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,02) |
| Devisenoptionen | (0,03) | (0,01) |
| Inflation-Capped Options | 0,00 | (0,01) |
| Zinscaps | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,02 | (0,02) |
| Zinsswaps | (0,01) | (0,05) |
| Total Return Swaps auf Indizes | (0,32) | (0,13) |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | 0,00 | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | (0,04) | 0,09 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,67 | 0,09 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (9,09) | (7,89) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (48,02) | (65,06) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ARGENTINIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | ARS | 14.487 | $ 294 | 0,02 |
| 53,892 % fällig am 01.03.2020 (a) | | 300 | 7 | 0,00 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 147.473 | 3.396 | 0,16 |
| Summe Argentinien | | | 3.697 | 0,18 |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Driver Australia Four Trust** | | | | |
| 2,185 % fällig am 21.08.2025 | AUD | 1.881 | 1.320 | 0,06 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027 | | 16.871 | 12.642 | 0,60 |
| 1,250 % fällig am 21.02.2022 | | 27.752 | 20.228 | 0,97 |
| 2,000 % fällig am 21.08.2035 | | 893 | 813 | 0,04 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2025 | | 14.841 | 12.443 | 0,59 |
| | | | 46.126 | 2,20 |
| Summe Australien | | | 47.446 | 2,26 |
| **BRASILIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,299 % fällig am 27.01.2025 | $ | 1.843 | 1.960 | 0,09 |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 27 | 29 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | | 300 | 329 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | £ | 100 | 144 | 0,01 |
| 6,625 % fällig am 16.01.2034 | | 400 | 569 | 0,03 |
| 7,375 % fällig am 17.01.2027 | $ | 3.400 | 3.896 | 0,18 |
| Summe Brasilien | | | 6.927 | 0,33 |
| **KANADA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 1.900 | 1.901 | 0,09 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.03.2021 | | 5.000 | 5.016 | 0,24 |
| **TransCanada PipeLines Ltd.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 16.10.2023 | | 100 | 104 | 0,00 |
| | | | 7.021 | 0,33 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | | |
| 0,500 % fällig am 01.12.2050 (b) | CAD | 6.278 | 5.075 | 0,24 |
| 1,250 % fällig am 01.12.2047 (b) | | 10.235 | 9.844 | 0,47 |
| 1,500 % fällig am 01.12.2044 (b) | | 5.340 | 5.244 | 0,25 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2031 (b) | | 11.160 | 12.549 | 0,60 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2021 (b) | | 24.961 | 21.023 | 1,00 |
| | | | 53.735 | 2,56 |
| Summe Kanada | | | 60.756 | 2,89 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Crown Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,713 % fällig am 17.07.2028 | $ | 2.400 | 2.389 | 0,11 |
| **CVP Cascade CLO Ltd.** | | | | |
| 3,751 % fällig am 16.01.2026 | | 258 | 257 | 0,01 |
| **Evans Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 3,441 % fällig am 28.05.2028 | | 1.000 | 995 | 0,05 |
| **Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.** | | | | |
| 3,512 % fällig am 20.04.2027 | | 899 | 897 | 0,04 |
| **ICG U.S. CLO Ltd.** | | | | |
| 3,451 % fällig am 16.01.2028 | | 340 | 338 | 0,02 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | | 250 | 249 | 0,01 |
| **Sound Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,472 % fällig am 20.07.2027 | $ | 500 | $ 501 | 0,03 |
| **THL Credit Wind River CLO Ltd.** | | | | |
| 3,467 % fällig am 15.10.2027 | | 250 | 250 | 0,01 |
| **Tralee CLO Ltd.** | | | | |
| 3,622 % fällig am 20.10.2027 | | 1.300 | 1.300 | 0,06 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 3,477 % fällig am 15.07.2027 | | 1.100 | 1.101 | 0,05 |
| 3,742 % fällig am 22.10.2031 | | 200 | 200 | 0,01 |
| | | | 8.477 | 0,40 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 300 | 318 | 0,02 |
| Summe Cayman Inseln | | | 8.795 | 0,42 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 3.100 | 467 | 0,02 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 204.500 | 31.686 | 1,51 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 36 | 6 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 35.400 | 5.331 | 0,26 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 113 | 18 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 56.300 | 8.478 | 0,40 |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 64.200 | 9.947 | 0,47 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 24 | 4 | 0,00 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | | 70 | 11 | 0,00 |
| | | | 55.948 | 2,66 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Denmark Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (b) | | 96.346 | 15.839 | 0,76 |
| Summe Dänemark | | | 71.787 | 3,42 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **France Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 01.03.2025 (b) | € | 25.731 | 31.298 | 1,49 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2028 (b)(f) | | 22.940 | 28.506 | 1,36 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2036 (b) | | 11.937 | 15.247 | 0,72 |
| 0,700 % fällig am 25.07.2030 (b)(f) | | 13.876 | 18.669 | 0,89 |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 (b) | | 12.222 | 21.146 | 1,01 |
| Summe Frankreich | | | 114.866 | 5,47 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | $ | 12.100 | 12.271 | 0,58 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.04.2046 (b) | € | 3 | 5 | 0,00 |
| Summe Deutschland | | | 12.276 | 0,58 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | $ | 2.400 | 2.489 | 0,12 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Adagio CLO Ltd.** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2029 | € | 3.300 | 3.771 | 0,18 |
| **Arbour CLO DAC** | | | | |
| 0,580 % fällig am 15.03.2029 | | 1.920 | 2.180 | 0,10 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,680 % fällig am 13.10.2029 | | 1.800 | 2.045 | 0,10 |
| 0,800 % fällig am 26.04.2029 | | 1.700 | 1.938 | 0,09 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 21.09.2029 | € | 700 | $ 798 | 0,04 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | | 500 | 570 | 0,03 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | | 7.190 | 8.189 | 0,39 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | | 4.080 | 4.647 | 0,22 |
| **Orwell Park CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,780 % fällig am 18.07.2029 | | 1.300 | 1.482 | 0,07 |
| **Tymon Park CLO Ltd.** | | | | |
| 0,590 % fällig am 21.01.2029 | | 900 | 1.023 | 0,05 |
| Summe Irland | | | 26.643 | 1,27 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 10.800 | 12.346 | 0,59 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 0,100 % fällig am 15.05.2023 (b) | € | 11.455 | 12.770 | 0,61 |
| 0,450 % fällig am 22.05.2023 (b) | | 15.831 | 17.677 | 0,84 |
| 1,650 % fällig am 23.04.2020 (b) | | 2.006 | 2.314 | 0,11 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2019 (b) | | 1 | 1 | 0,00 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (b) | | 13.278 | 16.304 | 0,77 |
| 2,600 % fällig am 15.09.2023 (b) | | 30.100 | 37.184 | 1,77 |
| 3,100 % fällig am 15.09.2026 (b) | | 2.930 | 3.812 | 0,18 |
| Summe Italien | | | 102.408 | 4,87 |
| **JAPAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | $ | 7.500 | 7.512 | 0,36 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2024 (b) | ¥ | 1.752.240 | 16.695 | 0,80 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2026 (b) | | 3.627.406 | 34.964 | 1,66 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2027 (b) | | 591.043 | 5.722 | 0,27 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (b) | | 1.738.090 | 16.850 | 0,80 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2029 (b) | | 390.151 | 3.782 | 0,18 |
| | | | 78.013 | 3,71 |
| Summe Japan | | | 85.525 | 4,07 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | € | 129 | 151 | 0,01 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Babson Euro CLO BV** | | | | |
| 0,509 % fällig am 25.10.2029 | € | 300 | 340 | 0,02 |
| **Barings Euro CLO BV** | | | | |
| 0,680 % fällig am 27.07.2030 | | 700 | 795 | 0,04 |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | | 2.900 | 3.312 | 0,16 |
| **Contego CLO BV** | | | | |
| 0,599 % fällig am 15.11.2026 | | 2.888 | 3.289 | 0,16 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | | 2.100 | 2.393 | 0,11 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | | 760 | 863 | 0,04 |
| **North Westerly CLO BV** | | | | |
| 0,644 % fällig am 15.01.2026 | | 1.651 | 1.881 | 0,09 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,600 % fällig am 04.08.2028 | | 1.400 | 1.593 | 0,07 |
| | | | 14.466 | 0,69 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (c)(e) | | 200 | 237 | 0,01 |

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

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (c)(e) | € | 1.000 | $ 1.263 | 0,06 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | $ | 3.200 | 3.265 | 0,15 |
| **JT International Financial Services BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.09.2023 | | 2.700 | 2.807 | 0,13 |
| **NXP BV** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.09.2022 | | 200 | 206 | 0,01 |
| **Waha Aerospace BV** | | | | |
| 3,925 % fällig am 28.07.2020 | | 150 | 151 | 0,01 |
| | | | 7.929 | 0,37 |
| Summe Niederlande | | | 22.395 | 1,06 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **New Zealand Government International Bond** | | | | |
| 2,000 % fällig am 20.09.2025 | NZD | 38.308 | 28.127 | 1,34 |
| 3,000 % fällig am 15.04.2020 | | 12.698 | 8.647 | 0,41 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2030 | | 1.011 | 856 | 0,04 |
| Summe Neuseeland | | | 37.630 | 1,79 |
| **PERU** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 7.900 | 2.622 | 0,13 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 17.100 | 5.723 | 0,27 |
| Summe Peru | | | 8.345 | 0,40 |
| **QATAR** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **State Of Qatar** | | | | |
| 2,983 % fällig am 21.12.2020 | $ | 10.000 | 9.975 | 0,47 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | | 2.200 | 2.310 | 0,11 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 1.700 | 2.030 | 0,10 |
| | | | 4.340 | 0,21 |
| Summe Katar | | | 14.315 | 0,68 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (c)(e) | € | 1.200 | 1.417 | 0,06 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (c)(e) | | 100 | 120 | 0,01 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | | |
| 5,462 % fällig am 16.02.2021 | $ | 700 | 734 | 0,03 |
| 5,877 % fällig am 15.07.2019 | | 400 | 400 | 0,02 |
| | | | 2.671 | 0,12 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 0,150 % fällig am 30.11.2023 (b) | € | 12.021 | 14.348 | 0,68 |
| 0,650 % fällig am 30.11.2027 (b) | | 55.026 | 69.779 | 3,32 |
| 0,700 % fällig am 30.11.2033 (b) | | 1 | 1 | 0,00 |
| 1,000 % fällig am 30.11.2030 (b) | | 2.361 | 3.146 | 0,15 |
| 1,400 % fällig am 30.07.2028 | | 5.800 | 7.246 | 0,35 |
| | | | 94.520 | 4,50 |
| Summe Spanien | | | 97.191 | 4,62 |
| **SWEDEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sweden Government International Bond** | | | | |
| 0,125 % fällig am 01.06.2032 | SEK | 47.716 | 6.487 | 0,31 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **UBS AG** | | | | |
| 3,031 % fällig am 08.06.2020 | $ | 6.100 | 6.133 | 0,29 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 0,869 % fällig am 13.09.2021 | € | 2.100 | $ 2.400 | 0,11 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.07.2020 | $ | 200 | 201 | 0,01 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 3,186 % fällig am 21.06.2021 | | 1.400 | 1.401 | 0,07 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | |
| 0,080 % fällig am 02.03.2020 | € | 900 | 1.026 | 0,05 |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | | 400 | 458 | 0,02 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | $ | 2.200 | 2.197 | 0,10 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 1.400 | 1.459 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (c)(e) | | 200 | 205 | 0,01 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (c)(e) | | 200 | 216 | 0,01 |
| **Sky Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 16.09.2019 | | 100 | 100 | 0,01 |
| | | | 9.663 | 0,46 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,911 % fällig am 18.03.2039 | £ | 112 | 140 | 0,01 |
| 0,931 % fällig am 18.06.2038 | | 106 | 132 | 0,01 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,061 % fällig am 15.01.2039 | | 10.740 | 12.972 | 0,62 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,457 % fällig am 21.01.2070 | | 4.050 | 5.166 | 0,24 |
| 3,148 % fällig am 21.01.2070 | $ | 700 | 702 | 0,03 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 8.000 | 10.220 | 0,49 |
| | | | 29.332 | 1,40 |
| | | AKTIEN | | |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 10,250 % | | 32.522 | 6.265 | 0,30 |
| | | PARI (000S) | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2026 (b) | £ | 45.530 | 69.163 | 3,29 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2028 (b) | | 4.179 | 6.721 | 0,32 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2029 (b) | | 13.791 | 22.368 | 1,06 |
| 0,125 % fällig am 22.11.2036 (b) | | 5.972 | 11.264 | 0,54 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2041 (b) | | 4.434 | 8.977 | 0,43 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2044 (b) | | 1 | 3 | 0,00 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2048 (b) | | 7.161 | 16.018 | 0,76 |
| 0,125 % fällig am 22.11.2056 (b) | | 11.474 | 29.408 | 1,40 |
| 0,125 % fällig am 22.11.2065 (b) | | 12.112 | 36.343 | 1,73 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2068 (b) | | 42 | 131 | 0,01 |
| 0,250 % fällig am 22.03.2052 (b) | | 10.506 | 25.747 | 1,23 |
| 0,375 % fällig am 22.03.2062 (b) | | 18.105 | 54.169 | 2,58 |
| 0,625 % fällig am 22.03.2040 (b) | | 4.604 | 9.880 | 0,47 |
| 0,625 % fällig am 22.11.2042 (b) | | 7.866 | 17.748 | 0,84 |
| 0,750 % fällig am 22.11.2047 (b) | | 25.001 | 62.836 | 2,99 |
| 1,125 % fällig am 22.11.2037 (b) | | 7.692 | 17.011 | 0,81 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 (b) | | 44.087 | 75.894 | 3,61 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2032 (b) | | 20.188 | 40.100 | 1,91 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2055 (b) | | 15.022 | 49.039 | 2,33 |
| 1,875 % fällig am 22.11.2022 (b) | | 18.762 | 27.798 | 1,32 |
| 2,500 % fällig am 16.04.2020 | | 32.634 | 43.051 | 2,05 |
| 2,500 % fällig am 17.07.2024 | | 14.949 | 24.099 | 1,15 |
| 4,125 % fällig am 22.07.2030 | | 828 | 1.905 | 0,09 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2046 | | 4.400 | 9.095 | 0,43 |
| | | | 658.768 | 31,35 |
| Summe Großbritannien | | | 704.028 | 33,51 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.09.2036 | $ | 5.843 | 5.748 | 0,27 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,844 % fällig am 25.06.2035 | | 181 | 179 | 0,01 |
| **AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,344 % fällig am 25.06.2029 | | 10 | 10 | 0,00 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.10.2034 | $ | 1.157 | $ 1.168 | 0,06 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,744 % fällig am 15.04.2033 | | 386 | 387 | 0,02 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,690 % fällig am 25.12.2036 | | 1.369 | 1.370 | 0,06 |
| 3,379 % fällig am 25.05.2035 | | 1.008 | 1.015 | 0,05 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,780 % fällig am 25.10.2037 | | 788 | 799 | 0,04 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,549 % fällig am 25.09.2036 | | 1.040 | 1.011 | 0,05 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,349 % fällig am 25.10.2034 | | 1.700 | 1.704 | 0,08 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.08.2036 | | 1.350 | 1.335 | 0,06 |
| 2,864 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 3.100 | 2.953 | 0,14 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,934 % fällig am 25.02.2036 | | 1.000 | 1.001 | 0,05 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 3,024 % fällig am 25.01.2032 | | 3 | 2 | 0,00 |
| **Encore Credit Receivables Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.01.2036 | | 1.400 | 1.376 | 0,07 |
| **Equity One Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.04.2034 | | 39 | 36 | 0,00 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,714 % fällig am 25.07.2036 | | 1.800 | 1.734 | 0,08 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 3,259 % fällig am 25.08.2034 | | 136 | 136 | 0,01 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 2,724 % fällig am 25.03.2036 | | 4.645 | 4.640 | 0,22 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.05.2037 | | 3.602 | 3.566 | 0,17 |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 3,530 % fällig am 25.04.2038 | | 99 | 99 | 0,00 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 3,064 % fällig am 25.01.2035 | | 1.867 | 1.853 | 0,09 |
| **Navient Student Loan Trust** | | | | |
| 3,554 % fällig am 25.03.2066 | | 4.844 | 4.867 | 0,23 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.10.2035 | | 1.500 | 1.466 | 0,07 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,694 % fällig am 25.03.2036 | | 1.500 | 1.479 | 0,07 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,199 % fällig am 25.07.2035 | | 200 | 201 | 0,01 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,709 % fällig am 25.05.2035 | | 4.544 | 4.375 | 0,21 |
| 2,714 % fällig am 25.09.2047 | | 1.914 | 1.869 | 0,09 |
| 4,034 % fällig am 25.06.2033 | | 22 | 23 | 0,00 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2023 | € | 376 | 430 | 0,02 |
| 4,080 % fällig am 25.04.2023 | $ | 154 | 156 | 0,01 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | | 947 | 952 | 0,04 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,064 % fällig am 25.10.2035 | | 136 | 136 | 0,01 |
| | | | 48.076 | 2,29 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 200 | 201 | 0,01 |
| 4,125 % fällig am 13.02.2022 | | 200 | 206 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 100 | 133 | 0,01 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | | 200 | 200 | 0,01 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | | 3.100 | 3.116 | 0,15 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 4.800 | 4.844 | 0,23 |
| 5,150 % fällig am 15.02.2050 | | 1.800 | 1.990 | 0,09 |
| 5,300 % fällig am 15.08.2058 | | 600 | 669 | 0,03 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 2,764 % fällig am 15.08.2022 | | 500 | 501 | 0,02 |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | | 1.600 | 1.604 | 0,08 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2021 | | 300 | 302 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Charter Communications Operating LLC** | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | $ 1.100 | $ 1.156 | 0,06 |
| **Consolidated Edison Co. of New York, Inc.** | | | |
| 2,749 % fällig am 25.06.2021 | 600 | 602 | 0,03 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | 1.500 | 1.507 | 0,07 |
| **Duke Energy Corp.** | | | |
| 2,400 % fällig am 15.08.2022 | 100 | 100 | 0,01 |
| **eBay, Inc.** | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2023 | 1.400 | 1.409 | 0,07 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | |
| 3,600 % fällig am 01.02.2023 | 100 | 102 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2023 | 100 | 104 | 0,01 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | 100 | 103 | 0,01 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | |
| 2,700 % fällig am 01.11.2023 | 100 | 100 | 0,00 |
| **Eversource Energy** | | | |
| 2,900 % fällig am 01.10.2024 | 100 | 102 | 0,01 |
| **Exelon Corp.** | | | |
| 5,150 % fällig am 01.12.2020 | 800 | 825 | 0,04 |
| **General Motors Co.** | | | |
| 3,365 % fällig am 07.08.2020 | 70 | 70 | 0,00 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | |
| 2,350 % fällig am 04.10.2019 | 100 | 100 | 0,00 |
| 3,872 % fällig am 04.10.2019 | 100 | 100 | 0,00 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 3,610 % fällig am 15.09.2020 | 9.500 | 9.593 | 0,46 |
| **Hyundai Capital America** | | | |
| 3,202 % fällig am 18.09.2020 | 8.400 | 8.407 | 0,40 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | 600 | 648 | 0,03 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | 100 | 102 | 0,01 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | |
| 0,000 % fällig am 05.03.2010 ^ | € 950 | 24 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 05.04.2011 ^ | 10 | 0 | 0,00 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** | | | |
| 2,694 % fällig am 30.06.2021 | $ 600 | 602 | 0,03 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 5,000 % fällig am 26.10.2020 | 100 | 102 | 0,01 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | 3.840 | 3.841 | 0,18 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | 100 | 100 | 0,00 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | |
| 2,600 % fällig am 15.12.2019 | 100 | 100 | 0,00 |
| **Ryder System, Inc.** | | | |
| 2,450 % fällig am 03.09.2019 | 100 | 100 | 0,00 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | 200 | 208 | 0,01 |
| **Sempra Energy** | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | 800 | 797 | 0,04 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | |
| 3,360 % fällig am 20.03.2023 | 394 | 395 | 0,02 |
| **Teva Pharmaceutical Finance LLC** | | | |
| 2,250 % fällig am 18.03.2020 | 100 | 99 | 0,00 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2020 | 200 | 203 | 0,01 |
| **VMware, Inc.** | | | |
| 3,900 % fällig am 21.08.2027 | 300 | 305 | 0,01 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | |
| 2,450 % fällig am 20.11.2019 | 300 | 300 | 0,01 |
| | | 46.072 | 2,19 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007** | | | |
| 7,467 % fällig am 01.06.2047 | 530 | 535 | 0,03 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 4,225 % fällig am 20.01.2047 | 2.273 | 2.211 | 0,11 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 4,294 % fällig am 25.09.2035 ^ | 101 | 85 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,291 % fällig am 25.09.2037 ^ | $ 543 | $ 529 | 0,03 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 4,200 % fällig am 25.09.2035 | 11 | 10 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2034 | 948 | 966 | 0,05 |
| **Civic Mortgage LLC** | | | |
| 3,892 % fällig am 25.06.2022 | 1.236 | 1.233 | 0,06 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | 1.736 | 1.751 | 0,08 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 4,312 % fällig am 20.04.2035 | 99 | 100 | 0,01 |
| 4,518 % fällig am 20.11.2034 | 69 | 70 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 2,977 % fällig am 30.11.2037 | 1.200 | 1.090 | 0,05 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,680 % fällig am 19.10.2045 | 4.174 | 4.020 | 0,19 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,844 % fällig am 25.06.2045 | 160 | 153 | 0,01 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,500 % fällig am 25.09.2035 | 129 | 133 | 0,01 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | 2.963 | 2.943 | 0,14 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 4,686 % fällig am 25.07.2035 | 459 | 466 | 0,02 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 3,141 % fällig am 20.10.2029 | 26 | 26 | 0,00 |
| 3,254 % fällig am 15.08.2032 | 367 | 361 | 0,02 |
| **OBX Trust** | | | |
| 3,054 % fällig am 25.06.2057 | 712 | 710 | 0,03 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 3,090 % fällig am 19.10.2026 | 12 | 13 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,469 % fällig am 25.09.2034 | 899 | 925 | 0,04 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | |
| 2,754 % fällig am 25.03.2035 | 320 | 298 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,674 % fällig am 25.12.2045 | 52 | 52 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.11.2045 | 1.422 | 1.395 | 0,07 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,766 % fällig am 25.10.2035 | 315 | 319 | 0,02 |
| | | 19.859 | 0,95 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 2,804 % fällig am 25.03.2049 | 9.671 | 9.649 | 0,46 |
| 3,682 % fällig am 01.09.2044 | 48 | 49 | 0,00 |
| 4,947 % fällig am 01.12.2030 | 2 | 2 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 229.010 | 234.106 | 11,14 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 133.900 | 138.393 | 6,59 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 2,534 % fällig am 25.08.2031 | 8 | 8 | 0,00 |
| 2,710 % fällig am 25.09.2031 | 15 | 15 | 0,00 |
| 2,994 % fällig am 15.12.2037 | 346 | 350 | 0,02 |
| 3,704 % fällig am 25.10.2044 | 469 | 474 | 0,02 |
| 4,245 % fällig am 01.09.2036 | 84 | 87 | 0,00 |
| 4,446 % fällig am 01.10.2036 | 49 | 52 | 0,00 |
| 4,536 % fällig am 01.07.2036 | 89 | 93 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 2,783 % fällig am 20.02.2049 | 9.570 | 9.563 | 0,46 |
| 3,030 % fällig am 20.08.2068 | 3.818 | 3.746 | 0,18 |
| 3,625 % fällig am 20.04.2030 | 12 | 13 | 0,00 |
| 4,125 % fällig am 20.05.2030 | 36 | 36 | 0,00 |
| **NCUA Guaranteed Notes** | | | |
| 2,979 % fällig am 08.12.2020 | 145 | 145 | 0,01 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 7,220 % fällig am 01.11.2020 | 2 | 2 | 0,00 |
| | | 396.783 | 18,88 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (b)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2021 | 29.075 | 28.811 | 1,37 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 (f) | 31.914 | 31.671 | 1,51 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2023 | 11.884 | 11.820 | 0,56 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 | $ 101 | $ 101 | 0,00 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 | 23.269 | 23.120 | 1,10 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | 7.502 | 7.513 | 0,36 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 (f) | 76.257 | 77.124 | 3,67 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | 33.805 | 34.050 | 1,62 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | 18.007 | 18.181 | 0,87 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 (f) | 31.415 | 31.939 | 1,52 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | 1.284 | 1.307 | 0,06 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 (f) | 141.606 | 145.063 | 6,90 |
| 0,625 % fällig am 15.02.2043 | 2.334 | 2.265 | 0,11 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | 50.659 | 52.805 | 2,51 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 | 6.185 | 6.216 | 0,30 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 (f) | 14.162 | 14.913 | 0,71 |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047 | 4.071 | 4.153 | 0,20 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | 28.985 | 30.405 | 1,45 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | 13.642 | 14.365 | 0,68 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049 | 11.981 | 12.685 | 0,60 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | 15.852 | 18.009 | 0,86 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 20.561 | 22.887 | 1,09 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2040 | 28.737 | 36.807 | 1,75 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 (f) | 57.835 | 74.575 | 3,55 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (f) | 81.966 | 91.623 | 4,36 |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 (f) | 22.299 | 26.837 | 1,28 |
| 3,375 % fällig am 15.04.2032 | 5.962 | 8.174 | 0,39 |
| 3,625 % fällig am 15.04.2028 (f) | 46.414 | 59.606 | 2,84 |
| | | 887.025 | 42,22 |
| Summe USA | | 1.398.350 | 66,56 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| **Broadcom, Inc.** | | | |
| 2,870 % fällig am 16.07.2019 | 1.200 | 1.198 | 0,06 |
| 2,910 % fällig am 09.07.2019 | 1.200 | 1.199 | 0,06 |
| **Campbell Soup Co.** | | | |
| 2,980 % fällig am 15.07.2019 | 400 | 399 | 0,02 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | |
| 2,800 % fällig am 17.07.2019 | 500 | 499 | 0,02 |
| **Enable Midstream Partners LP** | | | |
| 3,150 % fällig am 25.07.2019 | 700 | 699 | 0,03 |
| **Enbridge (U.S.), Inc.** | | | |
| 2,830 % fällig am 06.08.2019 | 1.400 | 1.396 | 0,07 |
| **Encana Corp.** | | | |
| 3,120 % fällig am 08.07.2019 | 300 | 300 | 0,02 |
| 3,200 % fällig am 01.08.2019 | 900 | 898 | 0,04 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | |
| 3,040 % fällig am 08.07.2019 | 2.400 | 2.398 | 0,11 |
| **Royal Caribbean Cruise** | | | |
| 2,850 % fällig am 30.07.2019 | 400 | 399 | 0,02 |
| 2,900 % fällig am 11.07.2019 | 300 | 300 | 0,01 |
| **Royal Caribbean Cruises** | | | |
| 2,970 % fällig am 01.07.2019 | 600 | 600 | 0,03 |
| | | 10.285 | 0,49 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (g)** | | | |
| | | 1.845 | 0,09 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 12.130 | 0,58 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | 4.102.603 | 41.088 | 1,95 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 2.891.858** | **137,64** |

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

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 205 | $ (22) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 49 | (56) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 134,500 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 303 | (8) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 119 | (297) | (0,02) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 118 | (239) | (0,01) |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09/2019 | 90 | 495 | 0,02 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 1.046 | 1.298 | 0,06 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 27 | (25) | 0,00 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 357 | (1.142) | (0,06) |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09/2019 | 3.793 | (593) | (0,03) |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 6 | 3 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 112,100 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 919 | 46 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 159,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 325 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 119 | 133 | 0,01 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 118 | 117 | 0,01 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | Short | 09/2019 | 145 | (260) | (0,01) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | Long | 09/2019 | 709 | 44 | 0,00 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | Long | 09/2019 | 15 | 32 | 0,00 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | Short | 09/2019 | 173 | (54) | 0,00 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 433 | (74) | 0,00 |
| | | | | $ (602) | (0,03) |

[1] Future-Style-Option.

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | $ 122,000 | 23.08.2019 | 49 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | 220,000 | 23.08.2019 | 41 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | 230,000 | 23.08.2019 | 12 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 114,500 | 23.08.2019 | 441 | 4 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 149,500 | 23.08.2019 | 468 | 4 | 1 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 103,250 | 23.08.2019 | 7 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 104,000 | 23.08.2019 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 123,000 | 23.08.2019 | 13 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 125,000 | 23.08.2019 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 125,500 | 23.08.2019 | 18 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 127,250 | 23.08.2019 | 124 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 10 | $ 1 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 129,000 | 26.07.2019 | 108 | $ (27) | $ (29) | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (630)** | **(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[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Ally Financial, Inc. | 5,000 % | 20.06.2022 | $ 100 | $ (4) | 0,00 |
| Daimler AG | 1,000 | 20.12.2020 | € 760 | (2) | 0,00 |
| Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2019 | 300 | 0 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2020 | $ 400 | 14 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 800 | 51 | 0,00 |
| | | | | $ 59 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-31 5-Year Index | (5,000) % | 20.12.2023 | $ 27.645 | $ (749) | (0,04) |
| CDX.HY-32 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2024 | 11.000 | (7) | 0,00 |
| | | | | $ (756) | (0,04) |

**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 | 2,000 % | 15.12.2047 | $ 8.250 | $ (365) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,428 | 20.12.2047 | 1.800 | (187) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,478 | 20.12.2047 | 4.292 | (508) | (0,02) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,499 | 20.12.2047 | 1.120 | (135) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month NZD-BBR | 3,250 | 21.03.2028 | NZD 8.200 | (774) | (0,04) |
| Zahlung[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,843 | 24.02.2025 | $ 47.400 | 245 | 0,01 |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,849 | 24.02.2025 | 47.400 | (257) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,850 | 20.07.2026 | 31.600 | (924) | (0,04) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 1,850 | 27.07.2026 | 12.150 | (355) | (0,02) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 27.07.2026 | 36.200 | (1.069) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.12.2022 | 1.500 | 24 | 0,00 |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 21.04.2026 | 5.500 | (168) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 27.04.2026 | 37.200 | (1.139) | (0,05) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,400 | 07.12.2026 | 11.000 | (374) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 19.12.2023 | 20.000 | 407 | 0,02 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 1.160 | (206) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,670 | 19.11.2023 | 14.000 | 262 | 0,01 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,677 | 25.10.2023 | 21.200 | 376 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,681 | 12.12.2023 | 14.000 | 274 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2048 | 1.800 | (165) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,953 | 12.12.2048 | 1.810 | (169) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,969 | 25.10.2048 | 3.180 | (294) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 9.500 | (2.191) | (0,10) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 3,100 | 17.04.2028 | 49.010 | (2.125) | (0,10) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 3,134 | 13.09.2028 | 46.200 | (2.095) | (0,10) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | € 21.400 | (27) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | £ 2.340 | (56) | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2029 | 1.870 | (89) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 20.03.2028 | ¥ 1.169.990 | (333) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 20.03.2029 | 108.870 | (39) | 0,00 |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,066 | 15.02.2024 | € 5.100 | 49 | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,165 | 15.12.2021 | 21.960 | (180) | (0,01) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,232 | 15.12.2023 | 27.600 | (602) | (0,03) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,323 | 15.03.2029 | 33.000 | (644) | (0,03) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,360 | 15.06.2027 | 12.000 | (676) | (0,03) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,563 | 15.09.2028 | 12.970 | (858) | (0,04) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,710 | 15.03.2033 | 1.900 | (193) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 1,954 | 03.06.2029 | $ 6.200 | 18 | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,550 | 26.07.2021 | 6.900 | (22) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,603 | 12.09.2021 | 6.020 | (19) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,678 | 24.05.2021 | 23.600 | (141) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 1,721 | 15.07.2020 | 6.090 | (8) | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,845 | 24.05.2026 | 5.900 | 116 | 0,01 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,927 | 18.03.2021 | 6.800 | (18) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,168 | 15.07.2020 | 11.700 | (67) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,210 | 05.02.2023 | 21.840 | (432) | (0,02) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,263 | 09.05.2023 | 7.120 | (182) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,281 | 10.05.2023 | 10.910 | (308) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 2,364 | 10.05.2028 | 6.700 | 341 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,370 | 06.06.2028 | 16.800 | 843 | 0,04 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,379 | 09.07.2028 | 700 | 37 | 0,00 |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,030 | 15.03.2024 | € 23.100 | (215) | (0,01) |
| Erhalt | FRCPXTOB | 1,350 | 15.01.2023 | 12.340 | 272 | 0,01 |
| Erhalt | FRCPXTOB | 1,590 | 15.02.2028 | 4.060 | 293 | 0,01 |
| Erhalt | UKRPI | 3,470 | 15.09.2032 | £ 2.420 | 7 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,579 | 15.10.2033 | 880 | 11 | 0,00 |
| | | | | | $ (15.034) | (0,71) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (15.731)** | **(0,75)** |

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

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

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

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

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 5.200 | $ (5) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 3.900 | (5) | (1) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 4.300 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 6.200 | (10) | (1) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 10.200 | (22) | (3) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 4.100 | (4) | (1) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 2.400 | (4) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 3.700 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 4.100 | (6) | (1) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 4.400 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 1.800 | (2) | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 5.000 | (8) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 7.700 | (8) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 5.700 | (7) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 1.600 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 4.700 | (7) | (1) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 2.200 | (4) | (1) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 3.800 | (4) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ (112) | $ (17) | 0,00 |

**INFLATION-CAPPED OPTIONS**

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Floor - OTC CPURNSA | $ 216,687 | Maximal [(1 + 0,000 %)10 - (Index Final/Index Initial)] oder 0 | 07.04.2020 | 25.400 | $ (226) | $ 0 | 0,00 |
| | Floor - OTC CPURNSA | 217,965 | Maximal [(1 + 0,000 %)10 - (Index Final/Index Initial)] oder 0 | 29.09.2020 | 2.900 | (37) | 0 | 0,00 |
| GLM | Cap - OTC CPALEMU | 100,151 | Maximal [(Index Final/Index Initial - 1) - 3,000 %] oder 0 | 22.06.2035 | 7.800 | (356) | (13) | 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 |
| | Floor - OTC YOY CPURNSA | 234,812 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 24.03.2020 | 31.300 | (354) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (1.268) | $ (13) | 0,00 |

**ZINSCAPS**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Call - OTC 1-Year Interest Rate Floor(2) | 10-Year USD-ISDA - 2-Year USD-ISDA | 0,000 % | 02.01.2020 | 120.500 | $ (93) | $ (14) | 0,00 |

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

(2) Das zugrunde liegende Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag(3) | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Mexico Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 6.700 | $ 64 | $ (65) | $ (1) | 0,00 |
| BPS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 2.600 | 26 | (27) | (1) | 0,00 |
| BRC | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 100 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 5.200 | 44 | (45) | (1) | 0,00 |
| HUS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 3.400 | 31 | (32) | (1) | 0,00 |
| JPM | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 1.400 | 12 | (12) | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 178 | $ (182) | $ (4) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF(2)**

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag(3) | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 % | 17.10.2057 | $ 12.200 | $ (713) | $ 855 | $ 142 | 0,01 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 2.500 | (6) | 2 | (4) | 0,00 |
| | | | | | $ (719) | $ 857 | $ 138 | 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.

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,374) % | 20.06.2020 | ILS 15.270 | $ 0 | $ (3) | $ (3) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,950 | 20.06.2028 | 3.290 | 0 | 46 | 46 | 0,00 |
| DUB | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,414) | 20.06.2020 | 14.860 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | Zahlung | CPURNSA | 2,500 | 15.07.2022 | $ 38.000 | 863 | (4.903) | (4.040) | (0,19) |
| GLM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | ILS 11.900 | 1 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,290) | 16.02.2020 | 29.300 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,270) | 21.03.2020 | 18.100 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,883 | 21.03.2028 | 3.790 | 0 | 54 | 54 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,971 | 16.02.2028 | 6.170 | (1) | 105 | 104 | 0,01 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 2.550 | 0 | 39 | 39 | 0,00 |
| HUS | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | (0,370) | 20.06.2020 | 9.550 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 2.050 | 0 | 31 | 31 | 0,00 |
| JPM | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 2,078 | 20.06.2028 | 3.170 | 0 | 54 | 54 | 0,00 |
| MYC | Erhalt | CPURNSA | (1,805) | 20.09.2026 | $ 2.400 | 0 | (30) | (30) | 0,00 |
| | | | | | | $ 863 | $ (4.626) | $ (3.763 | (0,18) |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 14.748 | $ | 16.560 | $ 0 | $ (235) | $ (235) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 2.165 | | 2.747 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | SGD | 1 | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 46.423 | AUD | 66.475 | 226 | 0 | 226 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 52.615 | CAD | 69.205 | 344 | 0 | 344 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 335.068 | € | 294.850 | 708 | 0 | 708 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 10.738 | £ | 8.567 | 165 | 0 | 165 | 0,01 |
| | 08/2019 | AUD | 66.475 | $ | 46.471 | 0 | (229) | (229) | (0,01) |
| | 08/2019 | CAD | 69.205 | | 52.653 | 0 | (345) | (345) | (0,02) |
| | 08/2019 | € | 294.850 | | 335.922 | 0 | (712) | (712) | (0,03) |
| | 11/2019 | TWD | 54.283 | | 1.731 | 0 | (33) | (33) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | ¥ | 273.200 | | 2.556 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 103 | ARS | 5.032 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.153 | € | 1.022 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 7.825 | £ | 6.154 | 17 | (10) | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.270 | MXN | 45.242 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 31.840 | $ | 4.895 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 45.242 | | 2.245 | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | DKK | 162.115 | | 24.425 | 0 | (310) | (310) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 3.021 | £ | 2.385 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 34.367 | $ | 1.730 | 0 | (47) | (47) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | ARS | 2.449 | | 50 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | AUD | 66.475 | | 46.019 | 0 | (630) | (630) | (0,03) |
| | 07/2019 | £ | 478.899 | | 606.788 | 0 | (2.707) | (2.707) | (0,13) |
| | 07/2019 | ¥ | 253.900 | | 2.368 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 55.830 | DKK | 367.083 | 179 | 0 | 179 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 640.067 | £ | 503.753 | 1.059 | 0 | 1.059 | 0,05 |
| | 08/2019 | £ | 503.753 | $ | 641.048 | 0 | (1.076) | (1.076) | (0,05) |
| | 08/2019 | PEN | 9.470 | | 2.815 | 0 | (61 | (61) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 9.720 | RUB | 638.909 | 346 | 0 | 346 | 0,02 |
| | 10/2019 | DKK | 367.083 | $ | 56.261 | 0 | (177) | (177) | (0,01) |
| | 10/2019 | PEN | 19.057 | | 5.641 | 0 | (128) | (128) | (0,01) |
| GLM | 07/2019 | COP | 30.267.686 | | 9.500 | 75 | 0 | 75 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.443 | € | 5.689 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 9.165 | IDR | 134.489.374 | 264 | 0 | 264 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 871 | THB | 27.235 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 9.457 | COP | 30.267.686 | 0 | (78) | (78) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 2.316 | MXN | 45.242 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 69.205 | $ | 51.338 | 0 | (1.621) | (1.621) | (0,08) |
| | 07/2019 | £ | 23 | | 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.249 | € | 1.098 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 35 | £ | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 76.400 | ¥ | 8.221.775 | 0 | (89) | (89) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 108 | TRY | 639 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 8.421.875 | $ | 78.441 | 86 | (1) | 85 | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 6.511 | | 4.765 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 174.425 | | 5.572 | 0 | (95) | (95) | 0,00 |
| IND | 07/2019 | SEK | 54.382 | | 5.673 | 0 | (188) | (188) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | DKK | 103.262 | | 15.768 | 18 | (5) | 13 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 7.916 | | 8.925 | 0 | (89) | (89) | 0,00 |

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

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | £ | 27.990 | | 35.367 | $ 0 | $ (256) | $ (256) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 7.694.675 | | 70.597 | 0 | (822) | (822) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 38.111 | € | 33.819 | 402 | 0 | 402 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 6.681 | £ | 5.253 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | INR | 27.132 | $ | 384 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | DKK | 102.795 | | 15.634 | 0 | (50) | (50) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 312.716 | | 349.679 | 0 | (6.441) | (6.441) | (0,31) |
| | 07/2019 | NZD | 56.043 | | 36.577 | 0 | (1.065) | (1.065) | (0,05) |
| | 07/2019 | $ | 11 | £ | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.660 | ZAR | 68.316 | 181 | 0 | 181 | 0,01 |
| SCX | 07/2019 | £ | 17.803 | $ | 22.544 | 0 | (114) | (114) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 37.487 | NZD | 56.043 | 154 | 0 | 154 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 5.864 | SEK | 54.382 | 0 | (3 | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | NZD | 56.043 | $ | 37.512 | 0 | (156) | (156) | (0,01) |
| | 08/2019 | SEK | 54.382 | | 5.878 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 10.829.613 | | 9.097 | 0 | (278) | (278) | (0,01) |
| | 11/2019 | TWD | 69.394 | | 2.217 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | £ | 46.347 | | 58.562 | 0 | (424) | (424) | (0,02) |
| TOR | 07/2019 | $ | 8.930 | COP | 30.267.686 | 494 | 0 | 494 | 0,02 |
| UAG | 09/2019 | CNH | 1.294 | $ | 187 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ 4.921 | $ (18.656) | $ (13.735) | (0,65) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional USD (Currency Exposure) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 1.516 | $ | 1.059 | $ 0 | $ (5) | $ (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 2.449 | | 1.862 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.060 | AUD | 1.516 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.863 | CAD | 2.449 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 22.981 | $ | 29.147 | 0 | (101) | (101) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 29.192 | £ | 22.981 | 101 | 0 | 101) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | € | 16.757 | $ | 19.044 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.049 | AUD | 1.516 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.988 | ¥ | 325.548 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 19.093 | € | 16.757 | 39 | 0 | 39 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 989 | £ | 782 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 1.817 | CAD | 2.449 | 57 | 0 | 57 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | | 793 | SEK | 7.605 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | | 205 | DKK | 1.351 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SEK | 7.605 | $ | 820 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 28.096 | £ | 22.198 | 156 | 0 | 156 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 822 | SEK | 7.605 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 378 | NZD | 575 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 18.738 | € | 16.757 | 346 | 0 | 346 | 0,02 |
| UAG | 07/2019 | ¥ | 325.548 | $ | 3.025 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 3.032 | ¥ | 325.548 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | | | | | | $ 809 | $ (159) | $ 650 | 0,03 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Class Z AUD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 3.800 | $ | 2.654 | $ 0 | $ (13) | $ (13) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.655 | AUD | 3.797 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 3.792 | $ | 2.652 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.611 | AUD | 3.772 | 36 | 0 | 36 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.655 | | 3.792 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 19 | | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | AUD | 56 | $ | 39 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| IND | 07/2019 | $ | 2.465 | AUD | 3.554 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 159 | | 229 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | AUD | 13 | $ | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.615 | AUD | 3.771 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | | | | | | $ 120 | $ (23) | $ 97 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend und Investor CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CHF | 170 | $ | 172 | $ 0 | $ (3) | $ (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 31.853 | CHF | 31.949 | 915 | 0 | 915 | 0,05 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | CHF | 390 | $ | 397 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 109 | CHF | 108 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF | 32.139 | $ | 32.821 | 0 | (143) | (143) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 30.480 | CHF | 30.546 | 849 | 0 | 849 | 0,04 |
| | 08/2019 | | 32.895 | | 32.118 | 143 | 0 | 143 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | CHF | 154 | $ | 158 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 32.007 | CHF | 32.216 | 1.035 | 0 | 1.035 | 0,05 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 32.439 | $ | 33.203 | 0 | (67) | (67) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 33.299 | CHF | 32.439 | 69 | 0 | 69 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CHF | 706 | $ | 722 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.817 | CHF | 1.809 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | | | | | | $ 3.051 | $ (217) | $ 2.834 | 0,14 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class R EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 233.975 | $ | 265.889 | $ 0 | $ (562) | $ (562) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ | 266.566 | € | 233.975 | 565 | 0 | 565 | 0,03 |
| BPS | 07/2019 | € | 228.515 | $ | 259.820 | 0 | (413) | (413) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 2.347 | € | 2.082 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 260.354 | | 228.401 | 414 | 0 | 414 | 0,02 |
| BRC | 07/2019 | | 233.804 | | 209.055 | 4.268 | 0 | 4.268 | 0,20 |
| CBK | 07/2019 | € | 240.922 | $ | 273.827 | 7 | (542) | (535) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 76.784 | € | 68.060 | 722 | 0 | 722 | 0,03 |
| | 08/2019 | | 266.590 | | 233.975 | 541 | 0 | 541 | 0,03 |
| GLM | 07/2019 | € | 365 | $ | 414 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.003 | € | 2.674 | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 222.869 | | 199.311 | 4.106 | 0 | 4.106 | 0,20 |
| RBC | 07/2019 | € | 98 | $ | 111 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | $ | 1.430 | € | 1.264 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 221 | $ | 249 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 13.033 | € | 11.618 | 197 | 0 | 197 | 0,01 |
| TOR | 07/2019 | | 233.767 | | 209.055 | 4.305 | 0 | 4.305 | 0,21 |
| | | | | | | $ 15.202 | $ (1.522) | $ 13.680 | 0,65 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | £ | 1.787 | $ | 2.266 | $ 0 | $ (9) | $ (9) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 41.019 | | 52.027 | 0 | (178) | (178) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 226 | £ | 179 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 51.347 | | 40.421 | 177 | 0 | 177 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | £ | 40.218 | $ | 51.102 | 0 | (84) | (84) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 52.045 | £ | 41.076 | 232 | 0 | 232 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 51.083 | | 40.142 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | £ | 383 | $ | 486 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.361 | £ | 1.077 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | £ | 88 | $ | 112 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 63 | £ | 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | £ | 69 | $ | 87 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | $ | 51.989 | £ | 41.076 | 288 | 0 | 288 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | | 49.527 | | 39.195 | 356 | 0 | 356 | 0,02 |
| | | | | | | $ 1.150 | $ (273) | $ 877 | 0,04 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 72 | SEK | 687 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 76 | | 727 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 5 | | 44 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SEK | 738 | $ | 80 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 76 | SEK | 731 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 80 | | 738 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,00 |

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

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional SGD (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | SGD 33.762 | $ 24.932 | $ 0 | $ (23) | $ (23) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 24.218 | SGD 33.419 | 483 | 0 | 483 | 0,02 |
| | 08/2019 | 25.017 | 33.862 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | 24.227 | 33.273 | 366 | 0 | 366 | 0,02 |
| DUB | 07/2019 | 24.213 | 33.327 | 420 | 0 | 420 | 0,02 |
| GLM | 07/2019 | SGD 33.917 | $ 25.049 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 25.123 | SGD 33.998 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SGD 33.633 | $ 24.789 | 0 | (70) | (70) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 24.879 | SGD 33.742 | 73 | 0 | 73 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | 22.649 | 31.208 | 417 | 0 | 417 | 0,02 |
| SCX | 07/2019 | SGD 32.617 | $ 24.116 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 1.973 | SGD 2.703 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 08/2019 | 24.189 | 32.701 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | | | | $ 1.837 | $ (118) | $ 1.719 | 0,08 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 2.456** | **0,12** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 62.400 | $ (62.886) | (2,99) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (62.886)** | **(2,99)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 2.815.067** | **133,99** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (714.062)** | **(33,99)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 2.101.005** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(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) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 429.786 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.842 und Barmittel in Höhe von USD 12.815 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 14.620 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 8.220 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(g) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 1.845 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | $ (1.884) | $ 1.845 | $ 1.845 | 0,09 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.884)** | **$ 1.845** | **$ 1.845** | **0,09** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | 41.088 $ | 2.840.795 $ | 9.975 $ | 2.891.858 $ |
| Finanzderivate[3] | (630) | (13.275) | 0 | (13.905) |
| Leerverkäufe | 0 | (62.886) | 0 | (62.886) |
| **Summen** | **40.458 $** | **2.764.634 $** | **9.975 $** | **2.815.067 $** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | 21.531 $ | 2.792.907 $ | 9.950 $ | $ 2.824.388 |
| Finanzderivate[3] | (7.456) | 408 | 0 | (7.048) |
| Leerverkäufe | 0 | (40.356) | 0 | (40.356) |
| **Summen** | **14.075 $** | **2.752.959 $** | **9.950 $** | **2.776.984 $** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,570 % | 08.05.2019 | 08.08.2019 | $ (91.533) | $ (91.886) | (4,37) |
| BPS | (0,300) | 17.04.2019 | 18.07.2019 | € (14.752) | (16.789) | (0,80) |
| CIB | 2,600 | 07.06.2019 | 17.07.2019 | $ (14.665) | (14.690) | (0,70) |
| GRE | 2,610 | 29.05.2019 | 10.07.2019 | (20.728) | (20.778) | (0,99) |
| IND | 2,560 | 09.05.2019 | 07.08.2019 | (25.394) | (25.489) | (1,21) |
| | 2,560 | 13.06.2019 | 07.08.2019 | (71.567) | (71.659) | (3,41) |
| | 2,570 | 16.05.2019 | 16.07.2019 | (6.909) | (6.932) | (0,33) |
| | 2,590 | 31.05.2019 | 12.07.2019 | (3.895) | (3.904) | (0,19) |
| | 2,600 | 06.06.2019 | 18.07.2019 | (6.488) | (6.500) | (0,31) |
| | 2,600 | 27.06.2019 | 18.07.2019 | (25.531) | (25.538) | (1,21) |
| SCX | 2,580 | 15.05.2019 | 15.07.2019 | (618) | (620) | (0,03) |
| | 2,590 | 30.05.2019 | 09.07.2019 | (33.421) | (33.498) | (1,59) |
| | 2,590 | 06.06.2019 | 24.07.2019 | (46.043) | (46.125) | (2,19) |
| | 2,600 | 17.04.2019 | 17.07.2019 | (17.092) | (17.184) | (0,82) |
| | 2,600 | 24.04.2019 | 24.07.2019 | (3.922) | (3.941) | (0,19) |
| | 2,600 | 23.05.2019 | 17.07.2019 | (12.927) | (12.963) | (0,62) |
| | 2,600 | 30.05.2019 | 17.07.2019 | (18.011) | (18.053) | (0,86) |
| | 2,600 | 06.06.2019 | 17.07.2019 | (767) | (769) | (0,04) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (417.318)** | **(19,86)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 787 | $ (730) | $ 57 |
| BPS | 557 | (420) | 137 |
| BRC | 3.965 | (3.840) | 125 |
| CBK | (925) | (1.330) | (2.255) |
| CKL | (1) | 0 | (1) |
| DUB | (3.627) | 3.220 | (407) |
| FBF | (1) | 0 | (1) |
| GLM | 1.579 | (2.060) | (481) |
| GST | 137 | 0 | 137 |
| HUS | (1.682) | 1.540 | (142) |
| IND | (133) | 0 | (133) |
| JPM | (282) | 200 | (82) |
| MYC | (45) | (387) | (432) |
| MYI | (3.232) | 2.840 | (392) |
| RYL | 11 | (50) | (39) |
| SAL | (4) | 0 | (4) |
| SCX | 269 | 0 | 269 |
| SSB | (60) | 0 | (60) |
| TOR | 5.145 | (4.950) | 195 |
| UAG | (2) | 0 | (2) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 105,30 | 88,53 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 32,25 | 56,42 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,09 | 0,07 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,03) | (0,38) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,75) | (0,05) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,12 | 0,07 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,99) | (2,07) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (19,86) | (28,21) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,18 | 0,46 |
| Australien | 2,26 | 2,37 |
| Brasilien | 0,33 | 0,32 |
| Kanada | 2,89 | 2,83 |
| Cayman-Inseln | 0,42 | 0,53 |
| Dänemark | 3,42 | 0,80 |
| Frankreich | 5,47 | 11,27 |
| Deutschland | 0,58 | 0,61 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,12 | 0,12 |
| Irland | 1,27 | 1,36 |
| Italien | 4,87 | 6,53 |
| Japan | 4,07 | 3,54 |
| Luxemburg | 0,01 | 0,18 |
| Niederlande | 1,06 | 1,17 |
| Neuseeland | 1,79 | 1,87 |
| Peru | 0,40 | 0,39 |
| Katar | 0,68 | 0,72 |
| Spanien | 4,62 | 1,83 |
| Schweden | 0,31 | 0,33 |
| Schweiz | 0,29 | 0,31 |
| Großbritannien | 33,51 | 29,00 |
| Vereinigte Staaten | 66,56 | 74,12 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,58 | 3,26 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 1,95 | 1,10 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,03) | (0,37) |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | (0,01) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,04) | 0,09 |
| Zinsswaps | (0,71) | (0,14) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,01) |
| Zinscaps | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,18) | (0,20) |
| Devisenterminkontrakte | (0,65) | 0,18 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,94 | 0,11 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,99) | (2,07) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (33,99) | (42,59) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | |
| **Advanz Pharma Corp.** | | | |
| 7,911 % fällig am 06.09.2024 | $ 25.512 | $ 24.534 | 0,03 |
| **Alphabet Holding Co., Inc.** | | | |
| 5,902 % fällig am 26.09.2024 | 4.323 | 4.092 | 0,01 |
| **Altice France S.A.** | | | |
| 6,394 % fällig am 14.08.2026 | 28.756 | 28.221 | 0,04 |
| **American Builders & Contractors Supply Co., Inc.** | | | |
| 4,402 % fällig am 31.10.2023 | 48.254 | 47.625 | 0,07 |
| **Ancestry.com Operations, Inc.** | | | |
| 5,660 % fällig am 19.10.2023 | 3.379 | 3.375 | 0,00 |
| **Aramark Services, Inc.** | | | |
| 4,080 % fällig am 11.03.2025 | 6.716 | 6.706 | 0,01 |
| **Avantor, Inc.** | | | |
| 5,402 % fällig am 21.11.2024 | 2.538 | 2.554 | 0,00 |
| **Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC** | | | |
| 4,133 % fällig am 15.01.2025 | 34.505 | 34.493 | 0,05 |
| **Axalta Coating Systems U.S. Holdings, Inc.** | | | |
| 4,080 % fällig am 01.06.2024 | 2.775 | 2.747 | 0,00 |
| **Bausch Health Cos., Inc.** | | | |
| 5,162 % fällig am 27.11.2025 | 9.825 | 9.780 | 0,01 |
| **Beacon Roofing Supply, Inc.** | | | |
| 4,663 % fällig am 02.01.2025 | 3.960 | 3.919 | 0,01 |
| **BWAY Holding Co.** | | | |
| 5,854 % fällig am 03.04.2024 | 3.371 | 3.263 | 0,00 |
| **Caesars Entertainment Operating Co.** | | | |
| 4,402 % fällig am 06.10.2024 | 20.389 | 20.277 | 0,03 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | |
| 5,152 % fällig am 22.12.2024 | 44.528 | 43.765 | 0,06 |
| **Camelot UK Holdco Ltd.** | | | |
| 5,652 % fällig am 03.10.2023 | 928 | 931 | 0,00 |
| **CenturyLink, Inc.** | | | |
| 5,152 % fällig am 31.01.2025 | 19.650 | 19.214 | 0,03 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | |
| 4,330 % fällig am 30.04.2025 | 67.089 | 67.080 | 0,09 |
| **CityCenter Holdings LLC** | | | |
| 4,652 % fällig am 18.04.2024 | 3.038 | 3.031 | 0,00 |
| **CommScope, Inc.** | | | |
| 5,652 % fällig am 06.04.2026 | 17.200 | 17.202 | 0,02 |
| **Core & Main LP** | | | |
| 5,520 % fällig am 01.08.2024 | 3.516 | 3.513 | 0,00 |
| **Crown Americas LLC** | | | |
| 2,375 % fällig am 03.04.2025 | € 3.465 | 3.983 | 0,01 |
| 4,401 % fällig am 03.04.2025 | $ 1.529 | 1.540 | 0,00 |
| **CSC Holdings LLC** | | | |
| 4,894 % fällig am 25.01.2026 | 10.593 | 10.488 | 0,01 |
| **DaVita, Inc.** | | | |
| 5,135 % fällig am 24.06.2021 | 4.528 | 4.530 | 0,01 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 4,410 % fällig am 07.09.2023 | 45.037 | 44.853 | 0,06 |
| **Delos Finance SARL** | | | |
| 4,080 % fällig am 06.10.2023 | 13.301 | 13.307 | 0,02 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 4,410 % fällig am 07.09.2023 | 45.037 | 44.853 | 0,06 |
| **Delos Finance SARL** | | | |
| 4,080 % fällig am 06.10.2023 | 13.301 | 13.307 | 0,02 |
| **Diamond (BC) BV** | | | |
| 5,583 % fällig am 06.09.2024 | 2.610 | 2.302 | 0,00 |
| **Diamond Resorts Corp.** | | | |
| 6,152 % fällig am 02.09.2023 | 52.917 | 50.161 | 0,07 |
| **Entercom Media Corp.** | | | |
| 5,152 % fällig am 18.11.2024 | 4.745 | 4.751 | 0,01 |
| **Envision Healthcare Corp.** | | | |
| 6,152 % fällig am 10.10.2025 | 53.233 | 46.346 | 0,06 |
| **Financial & Risk U.S. Holdings, Inc.** | | | |
| 3,773 % - 4,000 % fällig am 01.10.2025 | 99.799 | 96.947 | 0,13 |
| **First Data Corp.** | | | |
| 4,404 % fällig am 08.07.2022 | 29.214 | 29.214 | 0,04 |
| **Forest City Enterprises, L.P.** | | | |
| 6,402 % fällig am 07.12.2025 | 12.736 | 12.784 | 0,02 |
| **Gardner Denver, Inc.** | | | |
| 5,152 % fällig am 30.07.2024 | 351 | 352 | 0,00 |
| **Gates Global LLC** | | | |
| 5,152 % fällig am 01.04.2024 | 3.243 | 3.230 | 0,00 |
| **Genworth Holdings, Inc.** | | | |
| 6,993 % fällig am 07.03.2023 | $ 2.376 | $ 2.403 | 0,00 |
| **Golden Nugget, Inc.** | | | |
| 5,144 % - 7,250 % fällig am 04.10.2023 | 8.847 | 8.785 | 0,01 |
| **Grifols Worldwide Operations USA, Inc.** | | | |
| 4,635 % fällig am 31.01.2025 | 2.450 | 2.446 | 0,00 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 4,080 % fällig am 17.03.2023 | 7.300 | 7.310 | 0,01 |
| 4,330 % fällig am 13.03.2025 | 9.181 | 9.199 | 0,01 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | |
| 4,154 % fällig am 25.10.2023 | 64.007 | 64.115 | 0,09 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | |
| TBD% fällig am 01.05.2020 ^ | 7.600 | 7.619 | 0,01 |
| 6,579 % fällig am 01.05.2026 | 276.246 | 276.936 | 0,38 |
| **Ineos Finance LLC** | | | |
| 2,500 % fällig am 31.03.2024 | € 35.460 | 40.256 | 0,06 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | |
| 6,154 % fällig am 27.11.2023 | $ 72.035 | 71.337 | 0,10 |
| **IRB Holding Corp.** | | | |
| 5,644 % fällig am 05.02.2025 | 4.938 | 4.889 | 0,01 |
| **KFC Holding Co.** | | | |
| 4,132 % fällig am 03.04.2025 | 17.222 | 17.213 | 0,02 |
| **Kinetic Concepts Inc.** | | | |
| 5,580 % fällig am 02.02.2024 | 61.895 | 62.049 | 0,08 |
| **Klockner-Pentaplast of America, Inc.** | | | |
| 4,750 % fällig am 30.06.2022 | € 2.600 | 2.662 | 0,00 |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | |
| 4,152 % fällig am 27.03.2025 | $ 72.290 | 71.871 | 0,10 |
| **MA FinanceCo. LLC** | | | |
| 4,902 % fällig am 21.06.2024 | 3.050 | 2.997 | 0,00 |
| **Marriott Ownership Resorts, Inc.** | | | |
| 4,652 % fällig am 29.08.2025 | 5.771 | 5.781 | 0,01 |
| **McDermott Technology Americas, Inc.** | | | |
| 7,402 % fällig am 12.05.2025 | 16.486 | 16.237 | 0,02 |
| **Meredith Corp.** | | | |
| 5,152 % fällig am 31.01.2025 | 2.199 | 2.201 | 0,00 |
| **Messer Industrie GmbH** | | | |
| 4,830 % fällig am 01.03.2026 | 12.100 | 11.941 | 0,02 |
| **MGM Growth Properties Operating Partnership LP** | | | |
| 4,402 % fällig am 21.03.2025 | 11.984 | 11.932 | 0,02 |
| **MH Sub LLC** | | | |
| 6,152 % fällig am 13.09.2024 | 9.177 | 9.036 | 0,01 |
| **Ministry of Finance of Tanzania** | | | |
| 7,741 % fällig am 10.12.2019 | 7.550 | 7.601 | 0,01 |
| **Multi Color Corp.** | | | |
| 6,750 % fällig am 31.10.2024 | 1.545 | 1.548 | 0,00 |
| **NCI Building Systems, Inc.** | | | |
| 6,354 % fällig am 12.04.2025 | 29.141 | 28.412 | 0,04 |
| **Neiman Marcus Group Ltd. LLC** | | | |
| 7,972 % fällig am 25.10.2023 | 107.621 | 94.437 | 0,13 |
| **Nexstar Broadcasting, Inc.** | | | |
| 4,652 % fällig am 17.01.2024 | 2.844 | 2.830 | 0,00 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | |
| 4,412 % fällig am 04.10.2023 | 4.428 | 4.391 | 0,01 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics S.A.** | | | |
| 5,680 % fällig am 30.06.2025 | 2.645 | 2.548 | 0,00 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | |
| TBD% fällig am 22.02.2049 ^ | 33.626 | 32.785 | 0,04 |
| 2,440 % - 4,690 % fällig am 31.12.2020 | 57.819 | 57.783 | 0,08 |
| **Panther BF Aggregator LP** | | | |
| 5,902 % fällig am 30.04.2026 | 6.900 | 6.852 | 0,01 |
| **Parexel International Corp.** | | | |
| 5,152 % fällig am 27.09.2024 | 3.858 | 3.701 | 0,01 |
| **PetSmart, Inc.** | | | |
| 6,670 % fällig am 11.03.2022 | 22.344 | 21.735 | 0,03 |
| **PG&E Corp.** | | | |
| TBD% fällig am 31.12.2020 | 19.273 | 19.261 | 0,03 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | |
| 4,404 % fällig am 24.05.2024 | 23.379 | 23.302 | 0,03 |
| **Prestige Brands, Inc.** | | | |
| 4,402 % fällig am 26.01.2024 | $ 217 | $ 216 | 0,00 |
| **Reynolds Group Holdings, Inc.** | | | |
| 5,152 % fällig am 05.02.2023 | 3.209 | 3.190 | 0,00 |
| **RPI Finance Trust** | | | |
| 4,402 % fällig am 27.03.2023 | 12.998 | 13.025 | 0,02 |
| **SBA Senior Finance LLC** | | | |
| 4,410 % fällig am 11.04.2025 | 3.168 | 3.131 | 0,00 |
| **Seattle Spinco, Inc.** | | | |
| 4,902 % fällig am 21.06.2024 | 20.576 | 20.216 | 0,03 |
| **Sequa Mezzanine Holdings LLC** | | | |
| 7,560 % fällig am 28.11.2021 | 20.892 | 20.475 | 0,03 |
| 11,583 % fällig am 28.04.2022 | 7.670 | 7.363 | 0,01 |
| **Serta Simmons Bedding LLC** | | | |
| 5,894 % - 5,912 % fällig am 08.11.2023 | 1.466 | 948 | 0,00 |
| **SIG Combibloc Holdings S.C.A.** | | | |
| 2,500 % fällig am 02.10.2025 | € 9.800 | 11.236 | 0,02 |
| **Sigma Bidco BV** | | | |
| 3,500 % fällig am 02.07.2025 | 32.800 | 36.637 | 0,05 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 4,938 % fällig am 02.02.2024 | $ 49.631 | 48.969 | 0,07 |
| **SS&C Technologies Holdings Europe SARL** | | | |
| 4,652 % fällig am 16.04.2025 | 12.817 | 12.783 | 0,02 |
| **SS&C Technologies, Inc.** | | | |
| 4,652 % fällig am 16.04.2025 | 18.686 | 18.636 | 0,03 |
| **Starfruit Finco BV** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.10.2025 | € 3.600 | 4.122 | 0,01 |
| 5,669 % fällig am 01.10.2025 | $ 24.700 | 24.371 | 0,03 |
| **Syniverse Holdings, Inc.** | | | |
| 7,401 % fällig am 09.03.2023 | 14.398 | 13.349 | 0,02 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | |
| 4,402 % fällig am 08.11.2022 | 1.182 | 1.178 | 0,00 |
| **TEX Operations Co. LLC** | | | |
| 4,402 % fällig am 04.08.2023 | 4.577 | 4.570 | 0,01 |
| **TransDigm, Inc.** | | | |
| 4,830 % fällig am 22.08.2024 | 9.311 | 9.128 | 0,01 |
| **Tronox Finance LLC** | | | |
| 5,330 % - 5,402 % fällig am 23.09.2024 | 4.004 | 3.968 | 0,01 |
| **U.S. Renal Care, Inc.** | | | |
| TBD% fällig am 13.06.2026 | 14.040 | 13.817 | 0,02 |
| **Unitymedia Finance LLC** | | | |
| 4,644 % fällig am 15.01.2026 | 8.100 | 8.086 | 0,01 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2027 | € 23.400 | 26.681 | 0,04 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | |
| 5,152 % fällig am 15.03.2024 | $ 182.283 | 173.869 | 0,24 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | |
| 5,412 % fällig am 02.06.2025 | 7.645 | 7.650 | 0,01 |
| **VICI Properties LLC** | | | |
| 4,404 % fällig am 20.12.2024 | 29.543 | 29.263 | 0,04 |
| **West Corp.** | | | |
| 6,522 % fällig am 10.10.2024 | 2.056 | 1.922 | 0,00 |
| **Westmoreland Coal Co.** | | | |
| 12,500 % - 15,000 % fällig am 15.03.2029 | 4.810 | 3.969 | 0,01 |
| **Westmoreland Mining Holdings LLC** | | | |
| 10,660 % fällig am 15.03.2022 | 771 | 779 | 0,00 |
| **Wyndham Hotels & Resorts, Inc.** | | | |
| 4,152 % fällig am 30.05.2025 | 8.337 | 8.327 | 0,01 |
| | | 2.229.497 | 3,04 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € 27.041 | 31.174 | 0,04 |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | |
| 1,800 % fällig am 20.09.2019 | $ 900 | 899 | 0,00 |
| 2,450 % fällig am 04.06.2020 | 2.000 | 2.002 | 0,00 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | |
| 4,250 % fällig am 01.07.2020 | 2.750 | 2.791 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | 500 | 516 | 0,00 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | 2.580 | 2.646 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2021 | 1.100 | 1.154 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **AGFC Capital Trust** | | | | |
| 4,347 % fällig am 15.01.2067 | $ | 5.300 | $ 3.180 | 0,00 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 4,263 % fällig am 10.04.2025 | | 70.500 | 72.637 | 0,10 |
| 4,750 % fällig am 12.10.2023 | | 7.600 | 7.995 | 0,01 |
| **Akelius Residential Property AB** | | | | |
| 3,375 % fällig am 23.09.2020 | € | 8.800 | 10.445 | 0,01 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 30.04.2025 | $ | 14.480 | 14.913 | 0,02 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 46.198 | 46.319 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 21.05.2024 | | 17.247 | 17.700 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 15.292 | 15.478 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 13.02.2022 | | 4.519 | 4.643 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 15.04.2021 | | 35.720 | 36.524 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 15.09.2020 | | 863 | 910 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2020 | | 981 | 1.019 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 15.925 | 21.095 | 0,03 |
| **Alpha Bank AE** | | | | |
| 2,500 % fällig am 05.02.2023 | € | 39.213 | 47.058 | 0,06 |
| **Ambac LSNI LLC** | | | | |
| 7,319 % fällig am 12.02.2023 | $ | 75.473 | 76.888 | 0,11 |
| **American Honda Finance Corp.** | | | | |
| 2,915 % fällig am 05.11.2021 | | 185 | 185 | 0,00 |
| **American International Group, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.04.2048 | | 15.264 | 15.718 | 0,02 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2022 | | 3.070 | 3.055 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 15.06.2023 | | 10.022 | 10.126 | 0,01 |
| 3,300 % fällig am 15.02.2021 | | 4.690 | 4.750 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 15.09.2021 | | 5.480 | 5.600 | 0,01 |
| 5,900 % fällig am 01.11.2021 | | 1.690 | 1.819 | 0,00 |
| **Annington Funding PLC** | | | | |
| 1,650 % fällig am 12.07.2024 | € | 14.600 | 17.060 | 0,02 |
| 2,646 % fällig am 12.07.2025 | £ | 25.600 | 32.973 | 0,05 |
| 3,184 % fällig am 12.07.2029 | | 2.000 | 2.640 | 0,00 |
| **Ardonagh Midco PLC** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.07.2023 | | 33.370 | 39.095 | 0,05 |
| 8,625 % fällig am 15.07.2023 | $ | 600 | 562 | 0,00 |
| **Army Hawaii Family Housing Trust Certificates** | | | | |
| 2,794 % fällig am 15.06.2050 | | 106.530 | 84.262 | 0,12 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 19.01.2026 | € | 4.600 | 5.510 | 0,01 |
| 2,000 % fällig am 02.11.2026 | | 14.500 | 17.375 | 0,02 |
| 2,125 % fällig am 13.03.2023 | | 19.700 | 23.895 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 2.000 | 2.165 | 0,00 |
| **Assurant, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 27.09.2023 | | 6.870 | 7.151 | 0,01 |
| **Athene Holding Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 12.01.2028 | | 6.124 | 6.180 | 0,01 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 32.100 | 39.378 | 0,05 |
| **AvalonBay Communities, Inc.** | | | | |
| 3,027 % fällig am 15.01.2021 | $ | 17.938 | 17.946 | 0,02 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.05.2022 | | 8.620 | 8.748 | 0,01 |
| 5,125 % fällig am 01.10.2023 | | 13.456 | 14.277 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | | 18.514 | 19.784 | 0,03 |
| **AXA Equitable Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 20.04.2023 | | 2.588 | 2.698 | 0,00 |
| 4,350 % fällig am 20.04.2028 | | 6.045 | 6.363 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 20.04.2048 | | 9.012 | 9.313 | 0,01 |
| **Axis Bank Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 21.05.2020 | | 13.600 | 13.631 | 0,02 |
| **Banca Carige SpA** | | | | |
| 1,090 % fällig am 25.02.2021 | € | 245.400 | 280.602 | 0,38 |
| 1,389 % fällig am 25.10.2021 | | 64.700 | 74.515 | 0,10 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 2,000 % fällig am 29.01.2024 | | 35.600 | 41.886 | 0,06 |
| 2,875 % fällig am 16.07.2062 | | 35.000 | 43.007 | 0,06 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (i)(k) | | 22.600 | 26.495 | 0,04 |
| **Banco de Galicia y Buenos Aires S.A.** | | | | |
| 25,980 % fällig am 26.04.2020 | ARS | 767.000 | 12.817 | 0,02 |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 ^ | € | 16.200 | 4.520 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2018 ^ | | 8.100 | 2.260 | 0,00 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 3,724 % fällig am 12.04.2023 | $ | 4.600 | $ 4.584 | 0,01 |
| 3,848 % fällig am 12.04.2023 | | 6.800 | 7.064 | 0,01 |
| 4,379 % fällig am 12.04.2028 | | 5.400 | 5.752 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 19.03.2025 (i)(k) | € | 62.400 | 67.340 | 0,09 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (i)(k) | | 16.500 | 19.800 | 0,03 |
| **Bangkok Bank PCL** | | | | |
| 4,800 % fällig am 18.10.2020 | $ | 4.470 | 4.603 | 0,01 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 3,269 % fällig am 05.03.2024 | | 8.470 | 8.483 | 0,01 |
| **Bank of China Ltd.** | | | | |
| 0,190 % fällig am 17.04.2021 | € | 18.400 | 20.943 | 0,03 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (i)(k) | | 14.300 | 17.221 | 0,02 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (k) | $ | 92.720 | 101.305 | 0,14 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.01.2026 | € | 26.845 | 30.598 | 0,04 |
| 1,500 % fällig am 03.09.2023 | | 11.970 | 13.982 | 0,02 |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | £ | 30.565 | 38.953 | 0,05 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | | 49.200 | 64.496 | 0,09 |
| 3,200 % fällig am 10.08.2021 | $ | 7.600 | 7.657 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | £ | 68.342 | 88.892 | 0,12 |
| 3,250 % fällig am 17.01.2033 | | 400 | 497 | 0,00 |
| 3,650 % fällig am 16.03.2025 | $ | 10.919 | 10.998 | 0,02 |
| 3,684 % fällig am 10.01.2023 | | 26.800 | 27.165 | 0,04 |
| 3,905 % fällig am 16.05.2024 | | 50.800 | 50.087 | 0,07 |
| 3,932 % fällig am 07.05.2025 | | 62.200 | 63.349 | 0,09 |
| 3,948 % fällig am 15.02.2023 | | 13.041 | 12.981 | 0,02 |
| 4,209 % fällig am 10.01.2023 | | 6.600 | 6.617 | 0,01 |
| 4,337 % fällig am 10.01.2028 | | 4.100 | 4.202 | 0,01 |
| 4,338 % fällig am 16.05.2024 | | 2.700 | 2.790 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 12.01.2026 | | 29.300 | 30.386 | 0,04 |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | | 27.500 | 28.468 | 0,04 |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | | 49.260 | 52.581 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 15.09.2024 (i)(k) | £ | 54.388 | 67.230 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (i)(k) | € | 55.308 | 63.768 | 0,09 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (i)(k) | £ | 28.812 | 37.025 | 0,05 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (i)(k) | | 61.312 | 81.641 | 0,11 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (i)(k) | | 48.472 | 64.401 | 0,09 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (i)(k) | $ | 88.945 | 91.232 | 0,12 |
| 7,875 % fällig am 15.03.2022 (i)(k) | | 17.712 | 18.575 | 0,03 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (i)(k) | £ | 59.910 | 80.935 | 0,11 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (i)(k) | € | 95.117 | 117.390 | 0,16 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (i)(k) | $ | 47.600 | 49.955 | 0,07 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.02.2023 | € | 33.380 | 39.438 | 0,05 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 27.05.2021 | $ | 3.200 | 3.309 | 0,00 |
| 5,375 % fällig am 24.07.2023 | | 3.798 | 3.982 | 0,01 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | |
| 1,400 % fällig am 06.07.2022 | € | 22.600 | 26.360 | 0,04 |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | | 15.850 | 19.093 | 0,03 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | $ | 9.100 | 9.868 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 16.08.2028 (i)(k) | | 7.600 | 8.120 | 0,01 |
| 7,625 % fällig am 30.03.2021 (i)(k) | | 4.600 | 4.872 | 0,01 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.09.2021 | | 5.130 | 5.075 | 0,01 |
| 3,458 % fällig am 26.09.2023 | | 6.700 | 6.723 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 800 | 813 | 0,00 |
| 3,626 % fällig am 02.05.2021 | | 20.000 | 20.103 | 0,03 |
| **Boston Properties LP** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.01.2025 | | 2.380 | 2.431 | 0,00 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 12,500 % fällig am 30.09.2019 (i) | | 6.981 | 7.150 | 0,01 |
| 12,500 % fällig am 30.09.2019 (i) | € | 2.924 | 3.430 | 0,00 |
| **Brandywine Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.02.2023 | $ | 4.160 | 4.316 | 0,01 |
| 3,950 % fällig am 15.11.2027 | | 12.000 | 12.384 | 0,02 |
| **Brighthouse Financial, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 22.06.2027 | | 33.220 | 31.592 | 0,04 |
| **Brixmor Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.09.2023 | | 2.000 | 2.017 | 0,00 |
| 3,629 % fällig am 01.02.2022 | | 15.606 | 15.612 | 0,02 |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 25.01.2028 | | 13.190 | 13.463 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2024 | | 24.380 | 25.641 | 0,04 |
| 4,700 % fällig am 20.09.2047 | | 24.412 | 25.558 | 0,04 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2024 | $ | 2.486 | $ 2.566 | 0,00 |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | | 13.842 | 14.021 | 0,02 |
| **Capital One Financial Corp.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 30.04.2021 | | 31.742 | 32.328 | 0,04 |
| **Castellum AB** | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | € | 22.300 | 26.912 | 0,04 |
| **CBL & Associates LP** | | | | |
| 4,600 % fällig am 15.10.2024 | $ | 191 | 129 | 0,00 |
| 5,950 % fällig am 15.12.2026 | | 15.707 | 10.838 | 0,01 |
| **CC Holdings GS LLC** | | | | |
| 3,849 % fällig am 15.04.2023 | | 5.000 | 5.227 | 0,01 |
| **China Construction Bank Asia Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 02.07.2019 | | 7.541 | 7.540 | 0,01 |
| **China Construction Bank Corp.** | | | | |
| 0,262 % fällig am 24.09.2021 | € | 24.700 | 28.168 | 0,04 |
| 3,292 % fällig am 31.05.2020 | $ | 20.000 | 20.030 | 0,03 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.03.2021 | | 8.666 | 8.853 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 83.800 | 89.127 | 0,12 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2023 | | 82.535 | 88.416 | 0,12 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 3,531 % fällig am 24.07.2023 | | 1.601 | 1.607 | 0,00 |
| 3,540 % fällig am 25.04.2022 | | 942 | 950 | 0,00 |
| 3,625 % fällig am 17.05.2024 | | 1.300 | 1.313 | 0,00 |
| **CK Hutchison International Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 05.04.2022 | | 11.000 | 11.115 | 0,02 |
| **CNH Industrial Capital LLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.07.2019 | | 3.600 | 3.601 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 15.10.2021 | | 3.343 | 3.417 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 06.11.2020 | | 5.500 | 5.614 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 01.04.2021 | | 6.380 | 6.616 | 0,01 |
| **Compass Bank** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.09.2019 | | 5.000 | 5.000 | 0,01 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 4,625 % fällig am 29.12.2025 (i)(k) | € | 43.400 | 53.111 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (i)(k) | | 32.916 | 39.074 | 0,05 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (i)(k) | | 31.600 | 39.915 | 0,05 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 (m) | | 30.000 | 34.243 | 0,05 |
| **Corp. Andina de Fomento** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.10.2021 (h) | MXN | 13.018 | 670 | 0,00 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | € | 37.300 | 43.134 | 0,06 |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | | 37.520 | 43.827 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 800 | 829 | 0,00 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 3,601 % fällig am 24.04.2023 | | 5.000 | 4.991 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 24.04.2023 | | 11.000 | 11.425 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 23.01.2024 (i)(k) | | 1.590 | 1.755 | 0,00 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 4,375 % fällig am 05.08.2020 | | 5.250 | 5.363 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (k) | | 60.700 | 66.959 | 0,09 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,997 % fällig am 14.12.2023 | | 32.500 | 32.795 | 0,05 |
| 3,574 % fällig am 09.01.2023 | | 4.500 | 4.597 | 0,01 |
| 3,676 % fällig am 12.06.2024 | | 12.750 | 12.792 | 0,02 |
| 4,207 % fällig am 12.06.2024 | | 16.200 | 17.008 | 0,02 |
| 4,282 % fällig am 09.01.2028 | | 4.100 | 4.332 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (i)(k) | | 9.600 | 10.328 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (i)(k) | | 31.000 | 33.132 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (i) | | 510 | 562 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 11.12.2023 (i)(k) | | 4.250 | 4.687 | 0,01 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.03.2020 | | 5.300 | 5.309 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 16.04.2021 | | 4.700 | 4.775 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 33.230 | 34.729 | 0,05 |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 13.900 | 14.416 | 0,02 |
| 3,800 % fällig am 09.06.2023 | | 500 | 519 | 0,00 |
| 4,550 % fällig am 17.04.2026 | | 36.450 | 39.680 | 0,05 |
| 4,891 % fällig am 16.04.2021 | | 1.700 | 1.755 | 0,00 |
| **CTR Partnership LP** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2025 | | 4.748 | 4.938 | 0,01 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,180 % fällig am 07.12.2020 | € | 300 | 338 | 0,00 |
| 0,375 % fällig am 18.01.2021 | | 2.500 | 2.817 | 0,00 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 71.200 | 81.782 | 0,11 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2020 | £ | 20.800 | 26.461 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | € 69.100 | $ 79.895 | 0,11 |
| 2,625 % fällig am 12.02.2026 | 300 | 361 | 0,00 |
| 2,700 % fällig am 13.07.2020 | $ 51.430 | 51.223 | 0,07 |
| 3,150 % fällig am 22.01.2021 | 65.870 | 65.395 | 0,09 |
| 3,300 % fällig am 16.11.2022 | 300 | 295 | 0,00 |
| 3,407 % fällig am 22.01.2021 | 86.500 | 85.373 | 0,12 |
| 3,567 % fällig am 13.07.2020 | 15.732 | 15.633 | 0,02 |
| 3,715 % fällig am 16.11.2022 | 800 | 773 | 0,00 |
| 3,751 % fällig am 27.02.2023 | 11.600 | 11.190 | 0,02 |
| 3,855 % fällig am 04.02.2021 | 27.800 | 27.577 | 0,04 |
| 3,875 % fällig am 12.02.2024 | £ 2.500 | 3.264 | 0,00 |
| 3,950 % fällig am 27.02.2023 | $ 33.560 | 33.697 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 04.02.2021 | 38.900 | 39.257 | 0,05 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | 146.590 | 148.659 | 0,20 |
| **Deutsche Pfandbriefbank AG** | | | |
| 1,625 % fällig am 30.08.2019 | 20.000 | 19.983 | 0,03 |
| **Digital Realty Trust LP** | | | |
| 3,600 % fällig am 01.07.2029 | 21.953 | 22.288 | 0,03 |
| 3,700 % fällig am 15.08.2027 | 802 | 825 | 0,00 |
| **Discover Bank** | | | |
| 3,350 % fällig am 06.02.2023 | 5.950 | 6.093 | 0,01 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | 426 | 444 | 0,00 |
| **Dream Global Funding SARL** | | | |
| 1,750 % fällig am 28.06.2026 | € 29.900 | 34.435 | 0,05 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (f) | 18.647 | 20.572 | 0,03 |
| **EPR Properties** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.12.2026 | $ 1.894 | 2.006 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 15.04.2028 | 2.170 | 2.336 | 0,00 |
| **Equinix, Inc.** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.03.2024 | € 18.100 | 21.597 | 0,03 |
| 2,875 % fällig am 01.02.2026 | 23.944 | 28.624 | 0,04 |
| **Erste Group Bank AG** | | | |
| 8,875 % fällig am 15.10.2021 (i)(k) | 3.800 | 4.977 | 0,01 |
| **Eurobank Ergasias S.A.** | | | |
| 2,750 % fällig am 02.11.2050 | 5.840 | 6.861 | 0,01 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | 16.760 | 20.484 | 0,03 |
| 4,850 % fällig am 17.04.2028 | $ 23.558 | 24.861 | 0,03 |
| **Fastighets AB Balder** | | | |
| 1,125 % fällig am 14.03.2022 | € 8.155 | 9.482 | 0,01 |
| 1,875 % fällig am 14.03.2025 | 9.000 | 10.619 | 0,01 |
| 1,875 % fällig am 23.01.2026 | 13.080 | 15.312 | 0,02 |
| **FCE Bank PLC** | | | |
| 1,875 % fällig am 24.06.2021 | 4.600 | 5.361 | 0,01 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | $ 24.800 | 24.955 | 0,03 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | € 6.600 | 7.362 | 0,01 |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | 600 | 676 | 0,00 |
| 2,343 % fällig am 02.11.2020 | $ 5.956 | 5.916 | 0,01 |
| 2,425 % fällig am 12.06.2020 | 5.155 | 5.136 | 0,01 |
| 2,597 % fällig am 04.11.2019 | 17.835 | 17.827 | 0,02 |
| 3,157 % fällig am 04.08.2020 | 3.748 | 3.763 | 0,01 |
| 3,336 % fällig am 18.03.2021 | 375 | 377 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 02.08.2021 | 2.200 | 2.321 | 0,00 |
| 8,125 % fällig am 15.01.2020 | 2.630 | 2.705 | 0,00 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | 44.980 | 46.442 | 0,06 |
| 6,750 % fällig am 15.03.2022 | 50.464 | 52.546 | 0,07 |
| **Gateway Casinos & Entertainment Ltd.** | | | |
| 5,000 % fällig am 12.03.2038 | CAD 52.074 | 42.535 | 0,06 |
| **GE Capital European Funding Unlimited Co.** | | | |
| 0,000 % fällig am 17.05.2021 | € 850 | 967 | 0,00 |
| 0,069 % fällig am 21.01.2020 | 1.900 | 2.165 | 0,00 |
| 0,800 % fällig am 21.01.2022 | 16.300 | 18.926 | 0,03 |
| 2,625 % fällig am 15.03.2023 | 3.491 | 4.303 | 0,01 |
| 4,350 % fällig am 03.11.2021 | 4.800 | 6.014 | 0,01 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | $ 17.500 | 17.423 | 0,02 |
| 4,418 % fällig am 15.11.2035 | 11.500 | 11.401 | 0,02 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | |
| 4,125 % fällig am 13.09.2023 | £ 6.725 | 9.247 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 31.07.2019 | 1.360 | 1.735 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 04.11.2020 | 154 | 207 | 0,00 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | |
| 2,650 % fällig am 13.04.2020 | $ 21.100 | $ 21.097 | 0,03 |
| 3,150 % fällig am 15.01.2020 | 4.170 | 4.179 | 0,01 |
| 3,200 % fällig am 13.07.2020 | 7.022 | 7.048 | 0,01 |
| 3,527 % fällig am 13.04.2020 | 12.400 | 12.437 | 0,02 |
| 3,872 % fällig am 04.10.2019 | 1.700 | 1.704 | 0,00 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | |
| 2,875 % fällig am 20.06.2022 | € 13.500 | 16.322 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | 2.100 | 2.546 | 0,00 |
| **GLP Capital LP** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2025 | $ 4.884 | 5.245 | 0,01 |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | 17.666 | 19.106 | 0,03 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 3,200 % fällig am 23.02.2023 | 78.400 | 80.289 | 0,11 |
| 3,274 % fällig am 23.02.2023 | 87.100 | 86.881 | 0,12 |
| **Goodman U.S. Finance Three LLC** | | | |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | 21.137 | 21.397 | 0,03 |
| **Grainger PLC** | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2028 | £ 9.300 | 12.238 | 0,02 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | $ 9.600 | 10.135 | 0,01 |
| **High Street Funding Trust** | | | |
| 4,682 % fällig am 15.02.2048 | 2.000 | 2.176 | 0,00 |
| **Highwoods Realty LP** | | | |
| 4,125 % fällig am 15.03.2028 | 5.700 | 5.942 | 0,01 |
| **Hitachi Capital UK PLC** | | | |
| 3,210 % fällig am 20.11.2020 | 25.000 | 25.002 | 0,03 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | |
| 3,250 % fällig am 30.05.2022 | 69.200 | 69.975 | 0,10 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | |
| 3,875 % fällig am 01.04.2024 | 14.340 | 14.760 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 15.06.2025 | 1.430 | 1.482 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 01.03.2023 | 300 | 318 | 0,00 |
| **Howard Hughes Corp.** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.03.2025 | 38.914 | 40.401 | 0,06 |
| **HSBC Bank Argentina S.A.** | | | |
| 25,250 % fällig am 27.09.2019 | ARS 146.453 | 3.141 | 0,00 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | |
| 3,000 % fällig am 29.05.2030 | £ 22.100 | 28.964 | 0,04 |
| 3,033 % fällig am 22.11.2023 | $ 37.200 | 37.687 | 0,05 |
| 3,086 % fällig am 11.09.2021 | 70.800 | 70.879 | 0,10 |
| 3,120 % fällig am 18.05.2021 | 40.600 | 40.639 | 0,06 |
| 3,262 % fällig am 13.03.2023 | 6.900 | 7.032 | 0,01 |
| 3,520 % fällig am 18.05.2024 | 12.500 | 12.541 | 0,02 |
| 3,816 % fällig am 12.09.2026 | 28.000 | 28.039 | 0,04 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | 33.600 | 35.126 | 0,05 |
| 4,041 % fällig am 13.03.2028 | 6.100 | 6.413 | 0,01 |
| 4,292 % fällig am 12.09.2026 | 32.200 | 34.279 | 0,05 |
| 4,300 % fällig am 08.03.2026 | 4.500 | 4.837 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 04.07.2029 (i)(k) | € 17.700 | 21.214 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (i)(k) | 3.100 | 3.814 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 28.09.2026 (i)(k) | £ 33.400 | 44.735 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (i) | € 55.885 | 73.593 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (i)(k) | 5.400 | 7.111 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 23.03.2028 (i)(k) | $ 62.020 | 65.070 | 0,09 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | |
| 4,000 % fällig am 17.07.2019 | 16.272 | 16.279 | 0,02 |
| **Hudson Pacific Properties LP** | | | |
| 3,950 % fällig am 01.11.2027 | 3.177 | 3.237 | 0,00 |
| **Hunt Cos., Inc.** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2026 | 3.096 | 2.933 | 0,00 |
| **ICICI Bank Ltd.** | | | |
| 3,125 % fällig am 12.08.2020 | 1.500 | 1.504 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 18.03.2020 | 5.900 | 5.925 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 16.11.2020 | 18.348 | 19.041 | 0,03 |
| **IMMOFINANZ AG** | | | |
| 2,625 % fällig am 27.01.2023 | € 16.000 | 19.058 | 0,03 |
| **InCaps Funding Ltd.** | | | |
| 4,520 % fällig am 01.06.2033 | $ 6.138 | 5.954 | 0,01 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | |
| 2,625 % fällig am 26.05.2020 | 10.500 | 10.500 | 0,01 |
| 3,310 % fällig am 08.11.2020 | 35.361 | 35.436 | 0,05 |
| **ING Bank NV** | | | |
| 2,450 % fällig am 16.03.2020 | $ 5.100 | $ 5.106 | 0,01 |
| **ING Groep NV** | | | |
| 3,320 % fällig am 02.10.2023 | 18.200 | 18.191 | 0,02 |
| 4,100 % fällig am 02.10.2023 | 31.400 | 33.193 | 0,05 |
| 4,550 % fällig am 02.10.2028 | 16.600 | 18.284 | 0,03 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.04.2021 | 3.971 | 4.097 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 15.08.2022 | 3.210 | 3.498 | 0,00 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | 21.235 | 22.918 | 0,03 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2022 | 2.280 | 2.601 | 0,00 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 (i)(k) | € 1.270 | 1.632 | 0,00 |
| **iStar, Inc.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.09.2020 | $ 1.230 | 1.244 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 15.09.2022 | 1.832 | 1.880 | 0,00 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | |
| 6,250 % fällig am 03.06.2026 | 5.632 | 5.695 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 15.08.2024 | 3.700 | 3.653 | 0,01 |
| **Jefferies Group LLC** | | | |
| 6,500 % fällig am 20.01.2043 | 1.000 | 1.088 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | |
| 2,926 % fällig am 26.04.2021 | 63.300 | 63.387 | 0,09 |
| 3,086 % fällig am 26.04.2021 | 46.000 | 46.266 | 0,06 |
| **Kasikornbank PCL** | | | |
| 3,500 % fällig am 25.10.2019 | 13.700 | 13.755 | 0,02 |
| **KBC Group NV** | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (i)(k) | € 26.600 | 29.729 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 05.03.2024 (i)(k) | 25.600 | 30.969 | 0,04 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025 | 8.800 | 10.382 | 0,01 |
| 3,950 % fällig am 30.06.2022 | £ 13.707 | 17.867 | 0,02 |
| **Kennedy-Wilson, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.04.2024 | $ 8.172 | 8.376 | 0,01 |
| **Kojamo Oyj** | | | |
| 1,500 % fällig am 19.06.2024 | € 5.700 | 6.713 | 0,01 |
| 1,625 % fällig am 07.03.2025 | 7.100 | 8.346 | 0,01 |
| **Kookmin Bank** | | | |
| 2,250 % fällig am 03.02.2021 | $ 8.600 | 8.574 | 0,01 |
| **KSA Sukuk Ltd.** | | | |
| 2,894 % fällig am 20.04.2022 | 47.900 | 48.498 | 0,07 |
| **Liberty Living Finance PLC** | | | |
| 2,625 % fällig am 28.11.2024 | £ 8.250 | 10.657 | 0,01 |
| 3,375 % fällig am 28.11.2029 | 3.800 | 5.035 | 0,01 |
| **Life Storage LP** | | | |
| 3,875 % fällig am 15.12.2027 | $ 6.480 | 6.630 | 0,01 |
| **Lifestorage LP** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2026 | 9.340 | 9.348 | 0,01 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | |
| 3,300 % fällig am 07.05.2021 | 57.250 | 58.165 | 0,08 |
| 12,000 % fällig am 16.12.2024 (i) | 4.050 | 4.932 | 0,01 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | |
| 2,907 % fällig am 07.11.2023 | 6.500 | 6.514 | 0,01 |
| 3,900 % fällig am 12.03.2024 | 3.100 | 3.230 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 07.03.2025 | AUD 21.100 | 15.671 | 0,02 |
| 4,050 % fällig am 16.08.2023 | $ 31.400 | 32.799 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 22.03.2028 | 13.400 | 14.249 | 0,02 |
| 4,450 % fällig am 08.05.2025 | 20.100 | 21.417 | 0,03 |
| 4,550 % fällig am 16.08.2028 | 18.000 | 19.408 | 0,03 |
| 6,375 % fällig am 27.06.2020 (i)(k) | € 6.418 | 7.591 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 27.06.2024 (i)(k) | $ 24.502 | 25.819 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 27.09.2025 (i)(k) | 46.500 | 48.923 | 0,07 |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (i)(k) | £ 87.532 | 121.562 | 0,17 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (i)(k) | 41.972 | 60.727 | 0,08 |
| **LoanCore Capital Markets LLC** | | | |
| 6,875 % fällig am 01.06.2020 | $ 11.620 | 11.569 | 0,02 |
| **Logicor Financing SARL** | | | |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | € 32.235 | 37.999 | 0,05 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | 40.500 | 49.234 | 0,07 |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | 5.300 | 6.697 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Merlin Properties Socimi S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 26.05.2025 | € | 16.290 | $ 19.447 | 0,03 |
| 1,875 % fällig am 02.11.2026 | | 2.700 | 3.236 | 0,00 |
| **Mid-America Apartments LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2025 | $ | 9.900 | 10.487 | 0,01 |
| **Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,652 % fällig am 19.09.2022 | | 10.100 | 10.112 | 0,01 |
| **Mizuho Bank Ltd.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 26.03.2020 | | 6.700 | 6.706 | 0,01 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,601 % fällig am 11.09.2022 | | 36.400 | 36.392 | 0,05 |
| 3,331 % fällig am 11.09.2022 | | 88.950 | 89.491 | 0,12 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 3,095 % fällig am 10.02.2021 | | 87.100 | 87.218 | 0,12 |
| 3,125 % fällig am 23.01.2023 | | 27.980 | 28.631 | 0,04 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.10.2027 | | 23.020 | 23.768 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 01.08.2026 | | 750 | 785 | 0,00 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 12.07.2019 | | 4.435 | 4.434 | 0,01 |
| 2,625 % fällig am 23.07.2020 | | 1.250 | 1.255 | 0,00 |
| **National Bank of Greece S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 19.10.2020 | € | 4.900 | 5.758 | 0,01 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | $ | 34.200 | 34.929 | 0,05 |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | | 38.600 | 40.408 | 0,06 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | |
| 0,080 % fällig am 02.03.2020 | € | 15.800 | 18.010 | 0,02 |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | | 50.514 | 57.844 | 0,08 |
| **NatWest Markets PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 29.09.2022 | $ | 55.300 | 56.530 | 0,08 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 26.10.2020 | | 21.705 | 22.193 | 0,03 |
| 5,625 % fällig am 25.01.2025 | | 3.549 | 3.159 | 0,00 |
| 5,875 % fällig am 25.03.2021 | | 46.472 | 48.447 | 0,07 |
| 6,150 % fällig am 10.03.2021 | | 14.800 | 14.479 | 0,02 |
| 6,625 % fällig am 26.07.2021 | | 2.720 | 2.887 | 0,00 |
| 7,250 % fällig am 25.01.2022 | | 28.171 | 30.495 | 0,04 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 105.900 | 109.871 | 0,15 |
| **Newmark Group, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.11.2023 | | 10.106 | 10.701 | 0,01 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.08.2023 | | 8.470 | 8.805 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 (m) | | 7.270 | 7.705 | 0,01 |
| **Ontario Teachers' Cadillac Fairview Properties Trust** | | | | |
| 3,125 % fällig am 20.03.2022 | | 6.044 | 6.165 | 0,01 |
| **Oppenheimer Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.07.2022 | | 3.656 | 3.766 | 0,01 |
| **Physicians Realty LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.01.2028 | | 6.445 | 6.487 | 0,01 |
| **Preferred Term Securities Ltd.** | | | | |
| 2,610 % fällig am 22.12.2036 | | 1.613 | 1.524 | 0,00 |
| 2,700 % fällig am 22.06.2037 | | 23.503 | 20.918 | 0,03 |
| 2,710 % fällig am 22.03.2037 | | 27.549 | 24.932 | 0,03 |
| 2,710 % fällig am 22.09.2037 | | 22.462 | 20.552 | 0,03 |
| 2,720 % fällig am 22.12.2036 | | 31.851 | 29.940 | 0,04 |
| 2,750 % fällig am 22.09.2036 | | 2.787 | 2.648 | 0,00 |
| 2,760 % fällig am 22.12.2035 | | 20.419 | 19.092 | 0,03 |
| 2,760 % fällig am 22.03.2038 | | 14.696 | 13.594 | 0,02 |
| 2,780 % fällig am 22.09.2037 | | 11.897 | 9.637 | 0,01 |
| 2,790 % fällig am 23.09.2035 | | 4.287 | 4.158 | 0,01 |
| 2,790 % fällig am 22.03.2037 | | 13.187 | 10.088 | 0,01 |
| 2,810 % fällig am 22.03.2038 | | 15.639 | 13.308 | 0,02 |
| 2,840 % fällig am 22.12.2035 | | 2.271 | 1.953 | 0,00 |
| 2,860 % fällig am 22.03.2038 | | 9.259 | 7.685 | 0,01 |
| 2,867 % fällig am 26.09.2034 | | 17.323 | 16.976 | 0,02 |
| 2,890 % fällig am 23.09.2035 | | 6.734 | 5.960 | 0,01 |
| 2,910 % fällig am 23.03.2035 | | 6.604 | 6.240 | 0,01 |
| 2,990 % fällig am 23.03.2035 | | 10.000 | 8.850 | 0,01 |
| 3,310 % fällig am 22.03.2038 | | 1.718 | 1.701 | 0,00 |
| 3,470 % fällig am 03.07.2033 | | 1.653 | 1.571 | 0,00 |
| **Prologis International Funding S.A.** | | | | |
| 1,750 % fällig am 15.03.2028 | € | 5.375 | 6.558 | 0,01 |
| **Provident Funding Associates LP** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.06.2025 | $ | 1.601 | 1.513 | 0,00 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | | 77.500 | 79.075 | 0,11 |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 518.200 | 519.466 | 0,71 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 371.400 | 372.326 | 0,51 |
| **RBS Capital Trust** | | | | |
| 6,425 % fällig am 03.01.2034 (i) | $ | 1.600 | $ 2.044 | 0,00 |
| **RCI Banque S.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 12.07.2021 | € | 7.800 | 8.909 | 0,01 |
| **Reckson Operating Partnership LP** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.03.2020 | $ | 8.250 | 8.544 | 0,01 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.03.2026 | € | 31.800 | 37.139 | 0,05 |
| 2,000 % fällig am 08.03.2023 | | 17.400 | 20.474 | 0,03 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 59.650 | 70.608 | 0,10 |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | | 99.053 | 119.890 | 0,16 |
| 3,125 % fällig am 28.03.2027 | £ | 34.500 | 44.712 | 0,06 |
| 3,498 % fällig am 15.05.2023 | $ | 20.925 | 21.169 | 0,03 |
| 3,875 % fällig am 12.09.2023 | | 48.000 | 49.285 | 0,07 |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | | 3.950 | 3.944 | 0,01 |
| 3,988 % fällig am 15.05.2023 | | 35.015 | 34.931 | 0,05 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 31.400 | 32.493 | 0,04 |
| 4,445 % fällig am 08.05.2030 | | 88.200 | 91.374 | 0,13 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 600 | 625 | 0,00 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | | 22.975 | 24.596 | 0,03 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | | 11.470 | 12.258 | 0,02 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 96.500 | 104.780 | 0,14 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (i)(k) | | 29.337 | 30.144 | 0,04 |
| 8,000 % fällig am 10.08.2025 (i)(k) | | 43.366 | 46.998 | 0,06 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (i)(k) | | 58.072 | 62.732 | 0,09 |
| **Sabra Health Care LP** | | | | |
| 4,800 % fällig am 01.06.2024 | | 3.256 | 3.354 | 0,00 |
| **Sagax AB** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.01.2024 | € | 16.600 | 19.644 | 0,03 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | $ | 7.168 | 7.279 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 07.06.2024 | | 12.136 | 12.335 | 0,02 |
| 3,700 % fällig am 28.03.2022 | | 3.711 | 3.802 | 0,01 |
| 4,400 % fällig am 13.07.2027 | | 11.232 | 11.731 | 0,02 |
| 4,450 % fällig am 03.12.2021 | | 10.821 | 11.260 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 17.07.2025 | | 38.200 | 40.692 | 0,06 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 0,505 % fällig am 27.03.2024 | € | 17.200 | 19.259 | 0,03 |
| 2,875 % fällig am 05.08.2021 | $ | 26.100 | 26.149 | 0,04 |
| 2,920 % fällig am 08.05.2026 | £ | 3.800 | 4.930 | 0,01 |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | $ | 10.800 | 10.912 | 0,02 |
| 3,571 % fällig am 10.01.2023 | | 8.500 | 8.652 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 14.01.2026 | £ | 46.775 | 63.742 | 0,09 |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | $ | 23.300 | 23.553 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | | 2.300 | 2.391 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (i)(k) | £ | 61.153 | 81.453 | 0,11 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (i)(k) | | 49.924 | 67.630 | 0,09 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 10.05.2021 | | 24.400 | 31.256 | 0,04 |
| 2,125 % fällig am 03.11.2020 | $ | 2.130 | 2.120 | 0,00 |
| 3,140 % fällig am 01.06.2021 | | 3.300 | 3.308 | 0,00 |
| 3,400 % fällig am 01.06.2021 | | 28.200 | 28.678 | 0,04 |
| **SBA Tower Trust** | | | | |
| 2,877 % fällig am 15.07.2046 | | 15.700 | 15.748 | 0,02 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 3,352 % fällig am 15.11.2019 | € | 57.282 | 66.084 | 0,09 |
| 5,717 % fällig am 16.06.2021 | $ | 21.750 | 22.670 | 0,03 |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 64.600 | 68.698 | 0,09 |
| **SELP Finance SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 20.11.2025 | € | 6.000 | 7.062 | 0,01 |
| **SL Green Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.10.2022 | $ | 2.006 | 2.034 | 0,00 |
| **SL Green Realty Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.12.2022 | | 7.500 | 7.877 | 0,01 |
| **SLM Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 05.04.2022 | | 46.130 | 45.899 | 0,06 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 1,339 % fällig am 15.12.2039 | £ | 10.000 | 12.153 | 0,02 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.07.2021 | $ | 3.300 | 3.300 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | | 11.200 | 11.345 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 15.07.2023 | | 2.500 | 2.618 | 0,00 |
| **SMBC Trust Account** | | | | |
| 3,792 % fällig am 09.04.2021 | | 5.000 | 4.977 | 0,01 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.04.2028 (i)(k) | | 12.800 | 12.692 | 0,02 |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (i)(k) | | 58.400 | 60.778 | 0,08 |
| **Society of Lloyd's** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | £ | 6.280 | 8.845 | 0,01 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | $ | 89.400 | $ 95.211 | 0,13 |
| 6,125 % fällig am 15.05.2022 | | 134.221 | 144.623 | 0,20 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 15.668 | 16.882 | 0,02 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 | | 3.237 | 3.407 | 0,00 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | | 19.163 | 21.031 | 0,03 |
| 7,750 % fällig am 01.10.2021 | | 16.560 | 18.175 | 0,02 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 99.305 | 106.877 | 0,15 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 3,742 % fällig am 20.01.2023 | | 13.070 | 13.072 | 0,02 |
| 4,247 % fällig am 20.01.2023 | | 24.150 | 24.946 | 0,03 |
| **Starwood Property Trust, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.02.2021 | | 53.270 | 53.270 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 15.03.2025 | | 5.087 | 5.151 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 15.12.2021 | | 3.400 | 3.502 | 0,00 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 3,442 % fällig am 20.01.2020 | | 7.700 | 7.713 | 0,01 |
| 3,539 % fällig am 06.04.2020 | | 114.200 | 114.478 | 0,16 |
| **Stearns Holdings LLC** | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.08.2020 | | 15.297 | 14.609 | 0,02 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (i) | € | 63.613 | 88.852 | 0,12 |
| **STORE Capital Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2028 | $ | 4.590 | 4.841 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 15.03.2029 | | 2.584 | 2.753 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 2,514 % fällig am 17.01.2020 | | 43.300 | 43.335 | 0,06 |
| 2,938 % fällig am 17.01.2020 | | 43.300 | 43.361 | 0,06 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 2,442 % fällig am 19.10.2021 | | 5.000 | 5.009 | 0,01 |
| 3,102 % fällig am 17.01.2023 | | 8.172 | 8.324 | 0,01 |
| 3,328 % fällig am 17.01.2023 | | 30.030 | 30.034 | 0,04 |
| 3,732 % fällig am 19.10.2021 | | 5.218 | 5.293 | 0,01 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 19.09.2019 | | 22.400 | 22.375 | 0,03 |
| 2,859 % fällig am 19.09.2019 | | 26.900 | 26.930 | 0,04 |
| 3,511 % fällig am 18.10.2019 | | 33.000 | 33.084 | 0,05 |
| **Summit Properties Ltd.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 31.01.2025 | € | 7.300 | 8.015 | 0,01 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 | $ | 5.300 | 5.443 | 0,01 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | £ | 40.021 | 65.088 | 0,09 |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | | 9.904 | 16.298 | 0,02 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 12.763 | 21.244 | 0,03 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 32.081 | 54.007 | 0,07 |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 29.279 | 49.128 | 0,07 |
| 7,623 % fällig am 13.07.2039 | | 9.350 | 17.514 | 0,02 |
| **TLG Immobilien AG** | | | | |
| 1,375 % fällig am 27.11.2024 | € | 11.200 | 13.019 | 0,02 |
| **Toll Road Investors Partnership LP** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.02.2045 (f) | $ | 9.917 | 2.539 | 0,00 |
| **TP ICAP PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | £ | 3.300 | 4.395 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 42.300 | 55.147 | 0,08 |
| **U.S. Capital Funding Ltd.** | | | | |
| 2,864 % fällig am 10.07.2043 | $ | 5.959 | 5.333 | 0,01 |
| 3,329 % fällig am 01.08.2034 | | 4.686 | 4.475 | 0,01 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (k) | | 64.855 | 68.919 | 0,09 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (k) | | 5.500 | 6.172 | 0,01 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.02.2022 | | 17.500 | 17.594 | 0,02 |
| 2,859 % fällig am 15.08.2023 | | 56.800 | 57.328 | 0,08 |
| 3,468 % fällig am 15.08.2023 | | 50.000 | 50.125 | 0,07 |
| 3,491 % fällig am 23.05.2023 | | 16.000 | 16.411 | 0,02 |
| 3,744 % fällig am 23.05.2023 | | 9.000 | 9.095 | 0,01 |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 29.950 | 31.990 | 0,04 |
| 4,125 % fällig am 15.04.2026 | | 20.400 | 21.812 | 0,03 |
| 4,253 % fällig am 23.03.2028 | | 8.400 | 9.061 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 19.02.2022 (i)(k) | € | 9.750 | 12.245 | 0,02 |
| 7,000 % fällig am 19.02.2025 (i)(k) | $ | 2.500 | 2.744 | 0,00 |
| **UDR, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2028 | | 2.940 | 3.015 | 0,00 |
| 4,625 % fällig am 10.01.2022 | | 755 | 790 | 0,00 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 305.220 | 348.904 | 0,48 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | £ | 6.106 | $ | 8.735 | 0,01 |
| 7,395 % fällig am 28.03.2024 | | 6.368 | | 9.154 | 0,01 |
| **Ventas Realty LP** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.10.2026 | $ | 700 | | 706 | 0,00 |
| **VEREIT Operating Partnership LP** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.08.2027 | | 3.778 | | 3.897 | 0,01 |
| **VICI Properties LLC** | | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.10.2023 | | 16.593 | | 18.418 | 0,03 |
| **Virgin Money Holdings UK PLC** | | | | | |
| 8,750 % fällig am 10.11.2021 (i)(k) | £ | 1.240 | | 1.699 | 0,00 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | | |
| 0,102 % fällig am 15.06.2021 | € | 9.400 | | 10.695 | 0,01 |
| 0,625 % fällig am 08.09.2021 | | 22.100 | | 25.429 | 0,03 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 16.10.2020 | | 34.565 | | 39.498 | 0,05 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 07.09.2021 | £ | 3.800 | | 4.860 | 0,01 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | | |
| 0,140 % fällig am 06.07.2021 | € | 1.700 | | 1.933 | 0,00 |
| 0,250 % fällig am 16.02.2021 | | 34.580 | | 39.505 | 0,05 |
| 0,500 % fällig am 20.06.2022 | | 8.100 | | 9.268 | 0,01 |
| 1,000 % fällig am 16.02.2023 | | 9.215 | | 10.677 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 19.06.2026 | | 18.700 | | 21.545 | 0,03 |
| **Vornado Realty LP** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2025 | $ | 3.856 | | 3.939 | 0,01 |
| **Voyager Aviation Holdings LLC** | | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.08.2021 | | 13.900 | | 14.143 | 0,02 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 23.10.2026 | | 14.157 | | 14.317 | 0,02 |
| 3,196 % fällig am 17.06.2027 | | 5.500 | | 5.610 | 0,01 |
| 3,465 % fällig am 11.02.2022 | | 52.580 | | 52.901 | 0,07 |
| 3,584 % fällig am 22.05.2028 | | 27.500 | | 28.735 | 0,04 |
| 3,691 % fällig am 24.01.2023 | | 50.400 | | 51.032 | 0,07 |
| 3,813 % fällig am 31.10.2023 | | 45.600 | | 46.488 | 0,06 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | | | |
| 3,092 % fällig am 23.07.2021 | | 24.600 | | 24.630 | 0,03 |
| 3,325 % fällig am 23.07.2021 | | 22.400 | | 22.618 | 0,03 |
| **Welltower, Inc.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.04.2026 | | 1.600 | | 1.706 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 15.04.2028 | | 6.010 | | 6.432 | 0,01 |
| **WeWork Cos., Inc.** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.05.2025 | | 7.666 | | 7.602 | 0,01 |
| **WP Carey, Inc.** | | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.07.2029 | | 1.591 | | 1.610 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 01.10.2026 | | 6.400 | | 6.675 | 0,01 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.04.2027 | € | 12.800 | | 15.325 | 0,02 |
| 2,250 % fällig am 09.04.2026 | | 10.600 | | 12.890 | 0,02 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 18.04.2025 | £ | 6.000 | | 7.767 | 0,01 |
| | | | | 13.473.411 | 18,40 |

**INDUSTRIEWERTE**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | | 3.100 | | 3.611 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 31.07.2043 | | 12.200 | | 14.816 | 0,02 |
| 4,249 % fällig am 31.07.2043 | | 3.238 | | 4.189 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 6.700 | | 8.413 | 0,01 |
| **AbbVie, Inc.** | | | | | |
| 2,900 % fällig am 06.11.2022 | $ | 1.856 | | 1.870 | 0,00 |
| 3,375 % fällig am 14.11.2021 | | 19.198 | | 19.531 | 0,03 |
| **Adient U.S. LLC** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.05.2026 | | 1.637 | | 1.686 | 0,00 |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.07.2027 | | 2.558 | | 2.554 | 0,00 |
| **Allergan Funding SCS** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.03.2020 | | 5.930 | | 5.949 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 15.03.2022 | | 16.730 | | 17.088 | 0,02 |
| 3,691 % fällig am 12.03.2020 | | 8.153 | | 8.207 | 0,01 |
| **Allergan Sales LLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2021 | | 9.830 | | 10.283 | 0,01 |
| **Allergan, Inc.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.09.2020 | | 6.550 | | 6.610 | 0,01 |
| **Alliance Data Systems Corp.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2022 | € | 1.989 | | 2.323 | 0,00 |
| **Allied Universal Holdco LLC** | | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.07.2026 (c) | $ | 7.114 | $ | 7.239 | 0,01 |
| **ALROSA Finance S.A.** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 03.11.2020 | | 512 | | 543 | 0,00 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2023 | € | 31.040 | | 36.473 | 0,05 |
| 6,625 % fällig am 15.02.2023 | $ | 52.854 | | 54.307 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 15.05.2026 | | 11.175 | | 11.260 | 0,02 |
| **Altice France S.A.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | € | 34.228 | | 40.555 | 0,06 |
| 5,875 % fällig am 01.02.2027 | | 24.200 | | 29.918 | 0,04 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2024 | $ | 7.560 | | 7.815 | 0,01 |
| 7,375 % fällig am 01.05.2026 | | 131.523 | | 135.140 | 0,18 |
| 8,125 % fällig am 01.02.2027 | | 17.700 | | 18.629 | 0,03 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.04.2031 | | 4.171 | | 4.223 | 0,01 |
| 3,575 % fällig am 15.07.2029 | | 1.741 | | 1.810 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 15.08.2030 | | 6.660 | | 6.937 | 0,01 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2019 | | 1.198 | | 1.204 | 0,00 |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.03.2026 | € | 17.530 | | 20.478 | 0,03 |
| 3,875 % fällig am 28.09.2025 | $ | 500 | | 504 | 0,00 |
| **Arrow Electronics, Inc.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 08.09.2024 | | 2.662 | | 2.639 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 01.04.2022 | | 14.875 | | 15.123 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 12.01.2028 | | 10.570 | | 10.491 | 0,01 |
| **AutoNation, Inc.** | | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.01.2021 | | 1.690 | | 1.706 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.02.2020 | | 2.910 | | 2.953 | 0,00 |
| **Avon International Capital PLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.08.2022 (c) | | 4.224 | | 4.266 | 0,01 |
| **B.C. Unlimited Liability Co.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2024 | | 37.555 | | 38.071 | 0,05 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.05.2025 | | 11.600 | | 12.341 | 0,02 |
| 4,700 % fällig am 15.05.2028 | | 15.000 | | 16.061 | 0,02 |
| **Baidu, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 29.09.2023 | | 13.700 | | 14.216 | 0,02 |
| 4,375 % fällig am 29.03.2028 | | 4.400 | | 4.645 | 0,01 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | | |
| 2,297 % fällig am 14.08.2020 | | 1.590 | | 1.587 | 0,00 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | | 3.970 | | 3.980 | 0,01 |
| **Bausch Health Americas, Inc.** | | | | | |
| 8,500 % fällig am 31.01.2027 | | 4.064 | | 4.479 | 0,01 |
| **Bausch Health Cos., Inc.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2022 | | 4.481 | | 4.649 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 15.01.2028 | | 2.904 | | 3.017 | 0,00 |
| 7,250 % fällig am 30.05.2029 | | 5.704 | | 5.946 | 0,01 |
| **Baxalta, Inc.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 23.06.2020 | | 1.801 | | 1.807 | 0,00 |
| **BCPE Cycle Merger Sub, Inc.** | | | | | |
| 10,625 % fällig am 15.07.2027 | | 9.812 | | 9.959 | 0,01 |
| **Berry Global Escrow Corp.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2026 | | 7.873 | | 8.060 | 0,01 |
| **Board of Trustees of The Leland Stanford Junior University** | | | | | |
| 3,647 % fällig am 01.05.2048 | | 55.000 | | 59.830 | 0,08 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.04.2027 | | 17.120 | | 17.184 | 0,02 |
| **Brambles USA, Inc.** | | | | | |
| 5,350 % fällig am 01.04.2020 | | 990 | | 1.013 | 0,00 |
| **Broadcom Corp.** | | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.01.2021 | | 1.000 | | 992 | 0,00 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2020 | | 800 | | 799 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2022 | | 50.867 | | 51.018 | 0,07 |
| 3,625 % fällig am 15.01.2024 | | 7.425 | | 7.500 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 15.01.2027 | | 53.041 | | 52.024 | 0,07 |
| **Builders FirstSource, Inc.** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.06.2027 | | 2.600 | | 2.756 | 0,00 |
| **California Institute of Technology** | | | | | |
| 4,283 % fällig am 01.09.2116 | | 9.100 | | 10.314 | 0,01 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | | |
| 2,910 % fällig am 16.03.2020 | | 15.170 | | 15.183 | 0,02 |
| 3,040 % fällig am 15.03.2021 | | 12.330 | | 12.309 | 0,02 |
| **Catalent Pharma Solutions, Inc.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2027 | $ | 1.146 | $ | 1.169 | 0,00 |
| **CB IDEARC, Inc.** | | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.09.2022 | | 135.161 | | 0 | 0,00 |
| 10,625 % fällig am 15.03.2023 | | 37.870 | | 0 | 0,00 |
| 11,250 % fällig am 01.03.2021 | | 31.622 | | 0 | 0,00 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,978 % fällig am 15.02.2022 | | 59.600 | | 59.457 | 0,08 |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | | 73.050 | | 73.165 | 0,10 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 15.930 | | 16.076 | 0,02 |
| 4,229 % fällig am 01.02.2024 | | 68.922 | | 69.254 | 0,09 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 7.408 | | 7.787 | 0,01 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 5.680 | | 6.171 | 0,01 |
| **China Resources Gas Group Ltd.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 05.04.2022 (m) | | 2.620 | | 2.743 | 0,00 |
| **Cigna Corp.** | | | | | |
| 2,760 % fällig am 17.03.2020 | | 29.712 | | 29.742 | 0,04 |
| **Clear Channel Communication, Inc.** | | | | | |
| 9,000 % fällig am 01.03.2021 | | 185.177 | | 0 | 0,00 |
| 11,250 % fällig am 01.03.2021 | | 20.924 | | 0 | 0,00 |
| **Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2022 | | 24.167 | | 24.774 | 0,03 |
| 9,250 % fällig am 15.02.2024 | | 48.027 | | 52.229 | 0,07 |
| **Cleveland-Cliffs, Inc.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2024 | | 3.838 | | 3.905 | 0,01 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2021 | | 120.580 | | 118.319 | 0,16 |
| 6,250 % fällig am 31.03.2023 | | 221.256 | | 213.789 | 0,29 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2026 | | 59.524 | | 57.423 | 0,08 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2024 | | 97.452 | | 97.696 | 0,13 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | | |
| 3,092 % fällig am 09.10.2020 | | 21.410 | | 21.366 | 0,03 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(d) | | 5.533 | | 2.656 | 0,00 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (9,000 % bar und 0,500 % PIK)** | | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(d) | | 302 | | 145 | 0,00 |
| **Continental Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 6,703 % fällig am 15.12.2022 | | 250 | | 268 | 0,00 |
| **CSC Holdings LLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.02.2029 | | 6.600 | | 7.215 | 0,01 |
| **CSCEC Finance Cayman Ltd.** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 19.11.2020 | | 3.400 | | 3.415 | 0,01 |
| **CVS Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,163 % fällig am 11.08.2036 | | 1.702 | | 1.713 | 0,00 |
| 4,704 % fällig am 10.01.2036 | | 6.384 | | 6.794 | 0,01 |
| 5,926 % fällig am 10.01.2034 | | 921 | | 1.048 | 0,00 |
| 6,036 % fällig am 10.12.2028 | | 3.979 | | 4.459 | 0,01 |
| 6,943 % fällig am 10.01.2030 | | 7.299 | | 8.594 | 0,01 |
| 7,507 % fällig am 10.01.2032 | | 7.695 | | 9.300 | 0,01 |
| 8,353 % fällig am 10.07.2031 | | 6.057 | | 7.618 | 0,01 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.02.2020 | | 600 | | 604 | 0,00 |
| **DAE Funding LLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2020 | | 22.888 | | 22.945 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2022 | | 11.260 | | 11.457 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | | 15.335 | | 16.006 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 15.11.2021 | | 31.768 | | 33.078 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 15.11.2023 | | 30.377 | | 31.972 | 0,04 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | | |
| 3,350 % fällig am 04.05.2021 | | 3.800 | | 3.855 | 0,01 |
| **Danone S.A.** | | | | | |
| 1,691 % fällig am 30.10.2019 | | 4.900 | | 4.887 | 0,01 |
| **Davide Campari-Milano SpA** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.09.2020 | € | 800 | | 940 | 0,00 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | $ | 163.338 | | 168.363 | 0,23 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 500 | | 539 | 0,00 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 13.03.2020 | | 26.510 | | 26.547 | 0,04 |
| 3,400 % fällig am 19.04.2021 | | 2.105 | | 2.138 | 0,00 |
| 3,625 % fällig am 15.03.2022 | | 33.240 | | 33.828 | 0,05 |
| **Diamond Resorts International, Inc.** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | | 57.656 | | 59.602 | 0,08 |
| 10,750 % fällig am 01.09.2024 | | 1.500 | | 1.485 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.06.2020 | $ | 3.460 | $ 3.467 | 0,01 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | | 22.999 | 23.171 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 15.07.2022 | | 1.480 | 1.508 | 0,00 |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 43.229 | 43.499 | 0,06 |
| **DP World PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.09.2026 | € | 5.420 | 6.474 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 25.09.2030 | £ | 4.000 | 5.523 | 0,01 |
| **DriveTime Automotive Group, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.06.2021 | $ | 1.438 | 1.457 | 0,00 |
| **DXC Technology Co.** | | | | |
| 3,470 % fällig am 01.03.2021 | | 42.054 | 42.055 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 15.04.2027 | | 2.810 | 2.992 | 0,00 |
| **Eagle Holding Co. LLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 (d) | | 3.974 | 4.014 | 0,01 |
| **Eastern Creation Investment Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.09.2020 | | 16.384 | 16.397 | 0,02 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.07.2022 | | 4.173 | 4.183 | 0,01 |
| **EI Group PLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.02.2022 | £ | 4.000 | 5.243 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | | 7.740 | 10.511 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 09.05.2025 | | 4.850 | 6.678 | 0,01 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | $ | 99.370 | 98.842 | 0,14 |
| **Enbridge Energy Partners LP** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.10.2020 | | 2.380 | 2.435 | 0,00 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 73.780 | 73.802 | 0,10 |
| 3,110 % fällig am 15.06.2020 | | 41.200 | 41.319 | 0,06 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | | 5.730 | 5.830 | 0,01 |
| 4,200 % fällig am 15.09.2023 | | 4.398 | 4.614 | 0,01 |
| 4,650 % fällig am 01.06.2021 | | 3.980 | 4.130 | 0,01 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | | 5.960 | 6.129 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 01.03.2022 | | 3.050 | 3.273 | 0,00 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 31.01.2020 | | 3.480 | 3.534 | 0,01 |
| **EQT Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.10.2022 | | 8.330 | 8.269 | 0,01 |
| 3,089 % fällig am 01.10.2020 | | 30.124 | 30.106 | 0,04 |
| 4,875 % fällig am 15.11.2021 | | 11.700 | 12.240 | 0,02 |
| **Equifax, Inc.** | | | | |
| 3,388 % fällig am 15.08.2021 | | 9.652 | 9.630 | 0,01 |
| 3,600 % fällig am 15.08.2021 | | 3.390 | 3.456 | 0,00 |
| **Eurofins Scientific SE** | | | | |
| 2,125 % fällig am 25.07.2024 (m) | € | 7.580 | 8.629 | 0,01 |
| **Exela Intermediate LLC** | | | | |
| 10,000 % fällig am 15.07.2023 | $ | 8.158 | 6.669 | 0,01 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 21.05.2027 | € | 3.100 | 3.688 | 0,01 |
| 2,602 % fällig am 21.05.2025 | £ | 1.400 | 1.834 | 0,00 |
| 2,950 % fällig am 21.05.2039 | € | 3.030 | 3.834 | 0,01 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.07.2024 | $ | 24.392 | 24.638 | 0,03 |
| 3,200 % fällig am 01.07.2026 | | 15.448 | 15.792 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2029 | | 16.226 | 16.713 | 0,02 |
| 4,400 % fällig am 01.07.2049 | | 7.530 | 7.955 | 0,01 |
| **Flex Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.06.2029 | | 9.786 | 9.991 | 0,01 |
| **Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.10.2020 | | 4.460 | 4.522 | 0,01 |
| 5,625 % fällig am 31.07.2019 | | 3.096 | 3.102 | 0,00 |
| **G4S International Finance PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 09.01.2023 | € | 10.100 | 11.729 | 0,02 |
| **GATX Corp.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 30.07.2019 | $ | 1.760 | 1.760 | 0,00 |
| 3,285 % fällig am 05.11.2021 | | 30.300 | 30.181 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 15.06.2022 | | 2.180 | 2.305 | 0,00 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.05.2020 | € | 500 | 569 | 0,00 |
| 0,375 % fällig am 17.05.2022 | | 1.900 | 2.176 | 0,00 |
| 2,200 % fällig am 09.01.2020 | $ | 1.272 | 1.269 | 0,00 |
| 2,700 % fällig am 09.10.2022 | | 6.300 | 6.295 | 0,01 |
| 2,945 % fällig am 05.05.2026 | | 3.300 | 3.004 | 0,00 |
| 3,100 % fällig am 09.01.2023 | $ | 2.540 | $ 2.564 | 0,00 |
| 3,150 % fällig am 07.09.2022 | | 10 | 10 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 16.09.2020 | | 66 | 67 | 0,00 |
| 4,625 % fällig am 07.01.2021 | | 1.100 | 1.132 | 0,00 |
| 4,650 % fällig am 17.10.2021 | | 11.500 | 11.986 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 08.01.2020 | | 5.850 | 5.934 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 07.06.2021 | £ | 100 | 137 | 0,00 |
| 5,550 % fällig am 04.05.2020 | $ | 3.548 | 3.630 | 0,01 |
| 5,550 % fällig am 05.01.2026 | | 28.341 | 31.675 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 14.01.2038 | | 850 | 961 | 0,00 |
| 6,150 % fällig am 07.08.2037 | | 550 | 640 | 0,00 |
| 6,875 % fällig am 10.01.2039 | | 34 | 43 | 0,00 |
| **General Mills, Inc.** | | | | |
| 3,141 % fällig am 16.04.2021 | | 15.019 | 15.029 | 0,02 |
| **Go Daddy Operating Co. LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2027 | | 5.648 | 5.867 | 0,01 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 4,064 % fällig am 15.03.2035 | £ | 4.909 | 6.742 | 0,01 |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | | 3.467 | 5.119 | 0,01 |
| **GrubHub Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.07.2027 | $ | 2.700 | 2.778 | 0,00 |
| **Harris Corp.** | | | | |
| 3,063 % fällig am 30.04.2020 | | 44.300 | 44.290 | 0,06 |
| **Harvest Operations Corp.** | | | | |
| 2,330 % fällig am 14.04.2021 | | 17.638 | 17.552 | 0,02 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.10.2019 | | 18.280 | 18.355 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2020 | | 3.680 | 3.765 | 0,01 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2023 | | 10.610 | 11.302 | 0,02 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2030 | | 11.584 | 11.960 | 0,02 |
| **Holcim U.S. Finance SARL & Cie SCS** | | | | |
| 6,000 % fällig am 30.12.2019 | | 1.600 | 1.622 | 0,00 |
| **Huntsman International LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.05.2029 | | 3.726 | 3.849 | 0,01 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 3,202 % fällig am 18.09.2020 | | 16.602 | 16.616 | 0,02 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.05.2026 | | 63.142 | 67.325 | 0,09 |
| 8,375 % fällig am 01.05.2027 | | 114.445 | 120.455 | 0,16 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (d) | € | 8.200 | 9.502 | 0,01 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,735 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (d) | | 14.532 | 16.959 | 0,02 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar und 6,750 % PIK)** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2027 (d) | $ | 17.463 | 17.594 | 0,02 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar und 7,125 % PIK)** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2029 (d) | | 17.530 | 17.574 | 0,02 |
| **IMCD NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.03.2025 | € | 10.600 | 12.413 | 0,02 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.07.2020 | $ | 18.485 | 18.539 | 0,03 |
| **Incitec Pivot Finance LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 10.12.2019 | | 1.670 | 1.692 | 0,00 |
| **Indonesia Asahan Aluminium Persero PT** | | | | |
| 5,230 % fällig am 15.11.2021 | | 9.400 | 9.913 | 0,01 |
| 5,710 % fällig am 15.11.2023 | | 7.200 | 7.906 | 0,01 |
| **Intelsat Connect Finance S.A.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 15.02.2023 | | 24.150 | 21.494 | 0,03 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.08.2023 | | 9.396 | 8.621 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.02.2024 | | 39.077 | 40.835 | 0,06 |
| 8,500 % fällig am 15.10.2024 | | 56.174 | 55.893 | 0,08 |
| 9,750 % fällig am 15.07.2025 | | 41.472 | 42.509 | 0,06 |
| **Intelsat Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.06.2021 ^ | | 29.296 | 28.197 | 0,04 |
| **IQVIA, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.09.2025 | € | 3.400 | 4.028 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 15.03.2025 | | 6.500 | 7.651 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2027 | $ | 2.520 | 2.608 | 0,00 |
| **Japan Tobacco, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 13.04.2021 | | 2.600 | 2.578 | 0,00 |
| **JT International Financial Services BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.09.2023 | | 8.200 | 8.525 | 0,01 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 6,850 % fällig am 15.02.2020 | | 12.239 | 12.552 | 0,02 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.01.2032 | $ | 3.400 | $ 4.658 | 0,01 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | | |
| 2,118 % fällig am 11.09.2020 | | 1.950 | 1.941 | 0,00 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 02.07.2020 | | 1.480 | 1.482 | 0,00 |
| 3,115 % fällig am 10.02.2021 | | 890 | 889 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 1.000 | 1.024 | 0,00 |
| **LABL Escrow Issuer LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.07.2026 (c) | | 1.900 | 1.921 | 0,00 |
| **Martin Marietta Materials, Inc.** | | | | |
| 2,887 % fällig am 20.12.2019 | | 5.040 | 5.040 | 0,01 |
| 3,173 % fällig am 22.05.2020 | | 5.430 | 5.431 | 0,01 |
| **Masco Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2021 | | 12.750 | 12.944 | 0,02 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2020 | | 1.590 | 1.636 | 0,00 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 5,250 % fällig am 31.03.2020 | | 5.600 | 5.705 | 0,01 |
| 6,625 % fällig am 15.12.2021 | | 9.308 | 10.076 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | | 50.977 | 53.398 | 0,07 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | |
| 5,327 % fällig am 06.02.2029 | | 6.868 | 7.288 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 01.02.2025 | | 4.200 | 4.342 | 0,01 |
| **Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.07.2020 | | 11.000 | 11.088 | 0,02 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.12.2030 | | 6.357 | 5.941 | 0,01 |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | £ | 6.976 | 10.089 | 0,01 |
| **Molson Coors Brewing Co.** | | | | |
| 2,100 % fällig am 15.07.2021 | $ | 1.776 | 1.765 | 0,00 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.10.2021 | | 3.900 | 3.865 | 0,01 |
| **Mylan NV** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.06.2021 | | 1.500 | 1.501 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 15.12.2020 | | 5.250 | 5.301 | 0,01 |
| **Mylan, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 29.11.2023 | | 5.800 | 5.830 | 0,01 |
| **NetApp, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 29.09.2024 | | 1.395 | 1.421 | 0,00 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2027 | € | 36.305 | 45.262 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | | 42.071 | 52.019 | 0,07 |
| 4,625 % fällig am 15.05.2029 | | 51.700 | 67.039 | 0,09 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | $ | 10.540 | 11.222 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2022 | | 4.244 | 4.477 | 0,01 |
| **Newcrest Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.11.2021 | | 2.800 | 2.906 | 0,00 |
| **Nielsen Co. Luxembourg SARL** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2021 | | 500 | 503 | 0,00 |
| **Nokia Oyj** | | | | |
| 4,375 % fällig am 12.06.2027 | | 1.247 | 1.283 | 0,00 |
| **Norbord, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.07.2027 | | 3.400 | 3.430 | 0,00 |
| **Norwegian Air Shuttle ASA Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,875 % fällig am 10.11.2029 | | 3.676 | 3.557 | 0,01 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 21.07.2021 | | 1.500 | 1.488 | 0,00 |
| **NXP BV** | | | | |
| 3,875 % fällig am 18.06.2026 | | 5.000 | 5.143 | 0,01 |
| 4,300 % fällig am 18.06.2029 | | 12.800 | 13.206 | 0,02 |
| **ONGC Videsh Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.07.2019 | | 8.900 | 8.903 | 0,01 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2022 | | 23.915 | 22.958 | 0,03 |
| **Outfront Media Capital LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2027 | | 6.983 | 7.166 | 0,01 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 23.09.2020 | | 4.160 | 4.245 | 0,01 |
| **Par Pharmaceutical, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.04.2027 | | 12.989 | 12.794 | 0,02 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2021 | | 29.631 | 29.966 | 0,04 |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 35.705 | 36.943 | 0,05 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 79.067 | 83.677 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | | 47.542 | 51.309 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Pelabuhan Indonesia Persero PT** | | | | |
| 4,500 % fällig am 02.05.2023 | $ | 9.600 | $ 10.044 | 0,01 |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 ^ | | 53.114 | 8.498 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 ^ | | 50.574 | 8.345 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | | 47.576 | 7.612 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2026 ^ | | 63.177 | 10.108 | 0,01 |
| 9,750 % fällig am 17.05.2035 ^ | | 28.330 | 7.083 | 0,01 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 5,500 % fällig am 21.01.2021 | | 13.800 | 13.986 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 13.03.2027 | | 24.460 | 24.213 | 0,03 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 3.730 | 3.331 | 0,00 |
| **Petronas Capital Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 12.08.2019 | | 27.230 | 27.321 | 0,04 |
| **PetSmart, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2025 | | 6.000 | 5.850 | 0,01 |
| **Phillips 66** | | | | |
| 3,347 % fällig am 15.04.2020 | | 10.980 | 10.985 | 0,02 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.01.2021 | | 3.990 | 4.043 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 15.01.2020 | | 2.080 | 2.133 | 0,00 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.12.2029 (c) | | 5.300 | 5.333 | 0,01 |
| **QVC, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2023 | | 8.139 | 8.267 | 0,01 |
| 4,850 % fällig am 01.04.2024 | | 40.560 | 41.996 | 0,06 |
| 5,125 % fällig am 02.07.2022 | | 2.000 | 2.083 | 0,00 |
| 5,450 % fällig am 15.08.2034 | | 750 | 740 | 0,00 |
| **RAC Bond Co. PLC** | | | | |
| 4,870 % fällig am 06.05.2046 | £ | 5.000 | 6.261 | 0,01 |
| **Radiate Holdco LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2023 | $ | 20.957 | 21.062 | 0,03 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 30.09.2019 | | 26.060 | 26.301 | 0,04 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.06.2022 | | 10.185 | 10.179 | 0,01 |
| **Refinitiv U.S. Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2026 | € | 65.750 | 76.784 | 0,11 |
| 6,875 % fällig am 15.11.2026 | | 200 | 232 | 0,00 |
| **Rite Aid Corp.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.04.2023 | $ | 31.110 | 26.366 | 0,04 |
| **Roadster Finance DAC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.12.2024 | € | 1.800 | 2.050 | 0,00 |
| 2,375 % fällig am 08.12.2027 | | 7.000 | 8.026 | 0,01 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2020 | $ | 700 | 715 | 0,00 |
| **Rockpoint Gas Storage Canada Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 31.03.2023 | | 950 | 968 | 0,00 |
| **Rockwell Collins, Inc.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.03.2022 | | 1.196 | 1.209 | 0,00 |
| **Russian Railways via RZD Capital PLC** | | | | |
| 3,374 % fällig am 20.05.2021 | € | 51.962 | 62.555 | 0,09 |
| 7,487 % fällig am 25.03.2031 | £ | 9.350 | 14.772 | 0,02 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | $ | 20.286 | 21.077 | 0,03 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | | 21.000 | 22.114 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 26.400 | 28.365 | 0,04 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 29.600 | 32.221 | 0,04 |
| **Scientific Games International, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.02.2026 | € | 2.096 | 2.403 | 0,00 |
| **Shire Acquisitions Investments Ireland DAC** | | | | |
| 2,400 % fällig am 23.09.2021 | $ | 2.070 | 2.068 | 0,00 |
| **Sirius XM Radio, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2024 (c) | | 6.542 | 6.711 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2029 | | 9.600 | 9.866 | 0,01 |
| **Sky Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 26.11.2022 | | 3.400 | 3.488 | 0,01 |
| **SoftBank Group Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 20.04.2023 | € | 67.655 | 83.826 | 0,11 |
| **Solvay Finance America LLC** | | | | |
| 3,400 % fällig am 03.12.2020 | $ | 1.500 | 1.515 | 0,00 |
| **Spanish Broadcasting System, Inc.** | | | | |
| 12,500 % fällig am 15.04.2017 ^ | | 9.986 | 10.311 | 0,01 |
| **Spectra Energy Partners LP** | | | | |
| 3,179 % fällig am 05.06.2020 | | 4.800 | 4.815 | 0,01 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | |
| 3,474 % fällig am 28.12.2031 | £ | 2.000 | $ 2.526 | 0,00 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 3,360 % fällig am 20.03.2023 | $ | 34.655 | 34.750 | 0,05 |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | | 80.200 | 83.408 | 0,11 |
| 5,152 % fällig am 20.09.2029 | | 48.258 | 49.826 | 0,07 |
| **Staples, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2026 | | 13.625 | 13.579 | 0,02 |
| 10,750 % fällig am 15.04.2027 | | 7.317 | 7.299 | 0,01 |
| **Starfruit Finco BV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2026 | € | 300 | 346 | 0,00 |
| **Suntory Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 28.06.2022 | $ | 1.790 | 1.790 | 0,00 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | | 3.800 | 3.827 | 0,01 |
| 3,933 % fällig am 23.04.2021 | | 20.400 | 20.777 | 0,03 |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | | 5.000 | 5.201 | 0,01 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 5.000 | 5.222 | 0,01 |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 13.830 | 14.400 | 0,02 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2028 | | 2.461 | 2.541 | 0,00 |
| **Tech Data Corp.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.02.2022 | | 8.734 | 8.887 | 0,01 |
| 4,950 % fällig am 15.02.2027 | | 10.596 | 11.098 | 0,02 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | | |
| 5,134 % fällig am 27.04.2020 | | 3.870 | 3.950 | 0,01 |
| **Tenet Healthcare Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2024 | | 19.414 | 19.729 | 0,03 |
| **Teva Pharmaceutical Finance BV** | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | | 2.620 | 2.539 | 0,00 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Co. BV** | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | | 12.442 | 12.022 | 0,02 |
| **Teva Pharmaceutical Finance LLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 18.03.2020 | | 6.182 | 6.143 | 0,01 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 0,375 % fällig am 25.07.2020 | € | 49.780 | 55.778 | 0,08 |
| 1,700 % fällig am 19.07.2019 | $ | 400 | 399 | 0,00 |
| 2,200 % fällig am 21.07.2021 | | 30.792 | 29.329 | 0,04 |
| 2,800 % fällig am 21.07.2023 | | 4.388 | 3.807 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2022 | € | 48.750 | 54.915 | 0,08 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.09.2021 | $ | 2.160 | 2.218 | 0,00 |
| 4,125 % fällig am 15.02.2021 | | 2.354 | 2.398 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2020 | | 8.240 | 8.350 | 0,01 |
| **Times Square Hotel Trust** | | | | |
| 8,528 % fällig am 01.08.2026 | | 2.861 | 3.356 | 0,00 |
| **Topaz Solar Farms LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.09.2039 | | 7.039 | 7.000 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 30.09.2039 | | 43.888 | 46.423 | 0,06 |
| **Triumph Group, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.04.2021 | | 6.646 | 6.580 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 01.06.2022 | | 3.292 | 3.243 | 0,00 |
| **UCB S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 27.03.2020 | € | 1.634 | 1.911 | 0,00 |
| 4,125 % fällig am 04.01.2021 | | 951 | 1.149 | 0,00 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,750 % fällig am 03.03.2028 | $ | 11.060 | 11.511 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 11.10.2027 | | 700 | 737 | 0,00 |
| **United Group BV** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.07.2022 | € | 5.500 | 6.421 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 01.07.2024 | | 10.500 | 12.451 | 0,02 |
| **United Technologies Corp.** | | | | |
| 3,175 % fällig am 16.08.2021 | $ | 7.630 | 7.635 | 0,01 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2023 | | 6.628 | 6.512 | 0,01 |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | | 14.105 | 13.488 | 0,02 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.08.2026 | | 16.668 | 19.017 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 21.11.2036 | | 6.163 | 7.434 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 10.11.2039 | | 4.404 | 5.308 | 0,01 |
| **ViaSat, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2025 | | 51.331 | 50.689 | 0,07 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2027 | | 6.174 | 6.436 | 0,01 |
| **Virgin Australia Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,000 % fällig am 23.04.2025 | | 130 | 134 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 23.04.2022 | | 17 | 17 | 0,00 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | £ | 42.760 | $ 56.253 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 15.05.2029 | | 3.600 | 4.752 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.05.2029 | $ | 7.000 | 7.120 | 0,01 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 21.08.2020 | | 34.592 | 34.506 | 0,05 |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | | 38.400 | 38.723 | 0,05 |
| 3,900 % fällig am 21.08.2027 | | 5.890 | 5.980 | 0,01 |
| **VOC Escrow Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2028 | | 6.992 | 7.123 | 0,01 |
| **Vulcan Materials Co.** | | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2020 | | 1.590 | 1.590 | 0,00 |
| **Wabtec Corp.** | | | | |
| 3,710 % fällig am 15.09.2021 | | 9.914 | 9.889 | 0,01 |
| **Wesleyan University** | | | | |
| 4,781 % fällig am 01.07.2116 | | 2.800 | 3.159 | 0,00 |
| **Western Digital Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2026 | | 34.500 | 33.932 | 0,05 |
| **WestJet Airlines Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 16.06.2021 | | 3.650 | 3.672 | 0,01 |
| **Wind Tre SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 20.01.2023 | € | 16.500 | 18.969 | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 20.01.2024 | | 8.900 | 10.022 | 0,01 |
| 3,125 % fällig am 20.01.2025 | | 6.300 | 7.171 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 20.01.2026 | $ | 1.800 | 1.751 | 0,00 |
| **Wyndham Destinations, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.03.2023 | | 978 | 980 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 01.03.2022 | | 366 | 372 | 0,00 |
| 5,400 % fällig am 01.04.2024 | | 2.168 | 2.282 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 01.04.2027 | | 7.093 | 7.430 | 0,01 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 800 | 786 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 4.400 | 4.290 | 0,01 |
| **Yara International ASA** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.06.2028 | | 1.109 | 1.197 | 0,00 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 29.04.2022 | | 3.700 | 3.772 | 0,01 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.04.2020 | | 8.530 | 8.542 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | | 1.780 | 1.808 | 0,00 |
| 3,375 % fällig am 30.11.2021 | | 5.516 | 5.614 | 0,01 |
| 3,550 % fällig am 01.04.2025 | | 100 | 103 | 0,00 |
| | | | 5.906.640 | 8,06 |

**VERSORGUNGSUNTERNEHMEN**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 13.059 | 13.177 | 0,02 |
| 4,900 % fällig am 15.08.2037 | | 4.313 | 4.656 | 0,01 |
| **Centrais Eletricas Brasileiras S.A.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 30.07.2019 | | 2.790 | 2.798 | 0,00 |
| **China Shenhua Overseas Capital Co. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 20.01.2020 | | 3.400 | 3.406 | 0,00 |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 2,701 % fällig am 16.03.2020 | | 400 | 400 | 0,00 |
| **CNOOC Finance Australia Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.05.2020 | | 11.290 | 11.312 | 0,02 |
| **CNOOC Finance Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 26.01.2021 | | 2.900 | 2.978 | 0,00 |
| **Duke Energy Corp.** | | | | |
| 3,028 % fällig am 14.05.2021 | | 18.068 | 18.118 | 0,02 |
| **Duquesne Light Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,900 % fällig am 01.12.2021 | | 400 | 427 | 0,00 |
| 6,400 % fällig am 15.09.2020 | | 960 | 1.002 | 0,00 |
| **Edison International** | | | | |
| 2,400 % fällig am 15.09.2022 | | 5.098 | 4.858 | 0,01 |
| 2,950 % fällig am 15.03.2023 | | 647 | 620 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 15.06.2027 | | 4.445 | 4.782 | 0,01 |
| **Enable Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.05.2028 | | 7.349 | 7.711 | 0,01 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 25.05.2022 | | 3.300 | 3.327 | 0,00 |
| **Entergy Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2022 | | 1.190 | 1.238 | 0,00 |
| **Evergy, Inc.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 01.06.2021 | | 500 | 518 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Exelon Corp.** | | | |
| 5,150 % fällig am 01.12.2020 | $ 4.660 | $ 4.804 | 0,01 |
| **Fortis, Inc.** | | | |
| 2,100 % fällig am 04.10.2021 | 1.390 | 1.379 | 0,00 |
| **Frontier Communications Corp.** | | | |
| 8,000 % fällig am 01.04.2027 | 8.598 | 8.963 | 0,01 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | |
| 4,375 % fällig am 19.09.2022 | 52.000 | 53.114 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | 67.000 | 72.900 | 0,10 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | € 51.500 | 62.919 | 0,09 |
| 3,600 % fällig am 26.02.2021 | 24.012 | 28.875 | 0,04 |
| 4,250 % fällig am 06.04.2024 | £ 500 | 677 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 19.07.2022 | $ 1.200 | 1.261 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 06.02.2028 | 20.000 | 21.228 | 0,03 |
| 5,338 % fällig am 25.09.2020 | £ 4.865 | 6.484 | 0,01 |
| 5,999 % fällig am 23.01.2021 | $ 22.754 | 23.863 | 0,03 |
| 6,510 % fällig am 07.03.2022 | 28.950 | 31.326 | 0,04 |
| 7,288 % fällig am 16.08.2037 | 10.300 | 13.042 | 0,02 |
| 8,625 % fällig am 28.04.2034 | 38.699 | 52.876 | 0,07 |
| **Global Switch Holdings Ltd.** | | | |
| 2,250 % fällig am 31.05.2027 | € 1.400 | 1.705 | 0,00 |
| **Iberdrola Finance Ireland DAC** | | | |
| 5,000 % fällig am 11.09.2019 | $ 1.400 | 1.406 | 0,00 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | 666 | 663 | 0,00 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 | 3.128 | 3.018 | 0,00 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | |
| 2,450 % fällig am 15.08.2022 ^ | 22.568 | 21.778 | 0,03 |
| 2,950 % fällig am 01.03.2026 ^ | 84.317 | 79.469 | 0,11 |
| 3,250 % fällig am 15.09.2021 ^ | 16.025 | 15.705 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 15.06.2023 ^ | 42.557 | 41.493 | 0,06 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 ^ | 16.665 | 15.915 | 0,02 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | 60.955 | 58.060 | 0,08 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | 36.267 | 35.360 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2020 ^ | 82.770 | 81.115 | 0,11 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ | 51.015 | 49.357 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2024 ^ | 13.986 | 13.811 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 15.08.2042 ^ | 1.750 | 1.593 | 0,00 |
| 3,850 % fällig am 15.11.2023 ^ | 8.540 | 8.433 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2046 ^ | 632 | 577 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2021 ^ | 13.970 | 13.830 | 0,02 |
| 4,250 % fällig am 01.08.2023 ^ | 21.025 | 21.183 | 0,03 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045 ^ | 16.922 | 16.287 | 0,02 |
| 4,450 % fällig am 15.04.2042 ^ | 521 | 503 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.12.2041 ^ | 2.248 | 2.147 | 0,00 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2043 ^ | 5.461 | 5.365 | 0,01 |
| 4,650 % fällig am 01.08.2028 ^ | 4.100 | 4.203 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.02.2044 ^ | 15.569 | 15.958 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 15.11.2043 ^ | 9.034 | 9.294 | 0,01 |
| 5,400 % fällig am 15.01.2040 ^ | 1.634 | 1.765 | 0,00 |
| 5,800 % fällig am 01.03.2037 ^ | 15.434 | 16.939 | 0,02 |
| 6,050 % fällig am 01.03.2034 ^ | 13.650 | 15.288 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 01.03.2039 ^ | 9.838 | 11.166 | 0,02 |
| 6,350 % fällig am 15.02.2038 ^ | 3.255 | 3.711 | 0,01 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.02.2029 | 73.618 | 76.923 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 07.03.2022 | € 6.200 | 8.036 | 0,01 |
| 5,999 % fällig am 27.01.2028 | $ 127.711 | 135.948 | 0,19 |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | 62.241 | 66.824 | 0,09 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | 2.455 | 2.694 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | £ 34.000 | 48.960 | 0,07 |
| 6,625 % fällig am 16.01.2034 | 6.800 | 9.666 | 0,01 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | $ 4.182 | 4.346 | 0,01 |
| 7,375 % fällig am 17.01.2027 | 126.620 | 145.107 | 0,20 |
| 8,750 % fällig am 23.05.2026 | 21.295 | 26.339 | 0,04 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | |
| 6,650 % fällig am 15.01.2037 | 2.765 | 3.216 | 0,00 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | 17.300 | 19.463 | 0,03 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | 26.286 | 29.407 | 0,04 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | 12.038 | 13.873 | 0,02 |
| **Rosneft Finance S.A.** | | | |
| 7,250 % fällig am 02.02.2020 | 4.600 | 4.718 | 0,01 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | |
| 3,750 % fällig am 01.06.2047 | 276 | 265 | 0,00 |
| **Sempra Energy** | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | 73.200 | 72.918 | 0,10 |
| **SGSP Australia Assets Pty. Ltd.** | | | |
| 3,300 % fällig am 09.04.2023 | $ 2.250 | $ 2.297 | 0,00 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | |
| 1,750 % fällig am 29.09.2019 | 12.180 | 12.163 | 0,02 |
| 2,500 % fällig am 28.04.2020 | 1.600 | 1.600 | 0,00 |
| **Southern California Edison Co.** | | | |
| 3,650 % fällig am 01.03.2028 | 598 | 613 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 01.04.2035 | 1.104 | 1.259 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2034 | 302 | 362 | 0,00 |
| 6,650 % fällig am 01.04.2029 | 3.378 | 3.870 | 0,01 |
| **Southern California Gas Co.** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.11.2040 | 482 | 565 | 0,00 |
| **Southern Power Co.** | | | |
| 2,937 % fällig am 20.12.2020 | 28.600 | 28.610 | 0,04 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | 4.522 | 4.725 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 01.03.2020 | 29.100 | 29.900 | 0,04 |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | 90.021 | 93.509 | 0,13 |
| **Sprint Corp.** | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | 17.745 | 18.898 | 0,03 |
| **State Grid Overseas Investment Ltd.** | | | |
| 2,250 % fällig am 04.05.2020 | 1.300 | 1.298 | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 04.05.2022 | 3.400 | 3.413 | 0,00 |
| **Talen Energy Supply LLC** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 (c) | 3.826 | 3.816 | 0,01 |
| **Transocean Phoenix Ltd.** | | | |
| 7,750 % fällig am 15.10.2024 | 14.658 | 15.721 | 0,02 |
| **Transocean Proteus Ltd.** | | | |
| 6,250 % fällig am 01.12.2024 | 377 | 390 | 0,00 |
| **Transocean Sentry Ltd.** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2023 | 7.700 | 7.729 | 0,01 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 5,250 % fällig am 16.03.2037 | 5.937 | 7.111 | 0,01 |
| | | 1.938.688 | 2,65 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | 21.318.739 | 29,11 |

## WANDELANLEIHEN & WECHSEL

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Caesars Entertainment Corp.** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2024 | 28.682 | 49.166 | 0,07 |

## KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015** | | | |
| 7,375 % fällig am 01.01.2033 | 2.050 | 2.439 | 0,00 |
| 7,750 % fällig am 01.01.2042 | 952 | 1.076 | 0,00 |
| **Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2017** | | | |
| 7,045 % fällig am 01.01.2029 | 2.970 | 3.295 | 0,01 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2001** | | | |
| 5,125 % fällig am 01.07.2031 ^ | 15.000 | 11.175 | 0,02 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2004** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2025 ^ | 1.820 | 1.356 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2029 ^ | 2.180 | 1.624 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2006** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2031 ^ | 2.770 | 2.064 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 01.07.2023 ^ | 3.800 | 2.831 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 01.07.2026 ^ | 8.330 | 6.206 | 0,01 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2007** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2027 ^ | 5.015 | 3.736 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2028 ^ | 610 | 454 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 01.07.2032 ^ | 3.100 | 2.309 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 01.07.2034 ^ | 3.098 | 2.308 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 01.07.2037 ^ | 3.405 | 2.537 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2008** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2023 ^ | 2.535 | 1.889 | 0,00 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2028 ^ | 1.070 | 797 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2032 ^ | 9.320 | 6.943 | 0,01 |
| 5,700 % fällig am 01.07.2023 ^ | 4.565 | 3.401 | 0,01 |
| 5,900 % fällig am 01.07.2028 ^ | 1.195 | 890 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.07.2038 ^ | 3.520 | 2.622 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2009** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.07.2038 ^ | 4.360 | 3.248 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 01.07.2037 ^ | 3.100 | 2.309 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2011** | | | |
| 5,375 % fällig am 01.07.2030 ^ | $ 5.700 | $ 4.090 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 01.07.2041 ^ | 14.805 | 10.623 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 01.07.2040 ^ | 990 | 710 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2012** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2041 ^ | 31.225 | 18.345 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2037 ^ | 6.540 | 3.842 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2026 ^ | 14.605 | 8.581 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2039 ^ | 36.515 | 21.453 | 0,03 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2014** | | | |
| 8,000 % fällig am 01.07.2035 ^ | 97.685 | 50.796 | 0,07 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Notes, Series 2006** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.07.2016 ^ | 4.415 | 3.278 | 0,01 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Notes, Series 2007** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.07.2017 ^ | 1.800 | 1.337 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Notes, Series 2012** | | | |
| 4,125 % fällig am 01.07.2022 ^ | 4.380 | 2.508 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2021 ^ | 8.335 | 4.897 | 0,01 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 6,630 % fällig am 01.02.2035 | 5.545 | 6.400 | 0,01 |
| 6,725 % fällig am 01.04.2035 | 2.525 | 2.920 | 0,00 |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035 | 4.520 | 5.334 | 0,01 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, Series 2003** | | | |
| 5,100 % fällig am 01.06.2033 | 18.850 | 19.866 | 0,03 |
| **Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, Series 2006** | | | |
| 2,710 % fällig am 25.10.2036 | 14.788 | 14.696 | 0,02 |
| **Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | |
| 6,050 % fällig am 01.07.2032 ^ | 6.790 | 5.390 | 0,01 |
| 6,125 % fällig am 01.07.2040 ^ | 435 | 345 | 0,00 |
| **Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, Series 2008** | | | |
| 5,375 % fällig am 01.07.2022 ^ | 2.355 | 1.858 | 0,00 |
| **Texas Public Finance Authority Revenue Notes, Series 2014** | | | |
| 8,250 % fällig am 01.07.2024 | 14.985 | 15.058 | 0,02 |
| **University of California Revenue Bonds, Series 2012** | | | |
| 4,858 % fällig am 15.05.2112 | 12.280 | 14.941 | 0,02 |
| **Utah State Board of Regents Revenue Bonds, Series 2011** | | | |
| 3,429 % fällig am 01.05.2029 | 649 | 651 | 0,00 |
| | | 283.428 | 0,39 |

## US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Fannie Mae** | | | |
| 0,246 % fällig am 27.12.2022 (a) | 115.200 | 642 | 0,00 |
| 0,645 % fällig am 25.08.2022 (a) | 12.249 | 167 | 0,00 |
| 2,246 % fällig am 25.03.2035 (a) | 276 | 30 | 0,00 |
| 2,355 % fällig am 25.01.2022 (a) | 3.266 | 83 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 25.12.2027 - 25.02.2028 (a) | 16.158 | 1.061 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.05.2048 | 39.477 | 39.143 | 0,05 |
| 3,000 % fällig am 25.06.2042 (a) | 45 | 5 | 0,00 |
| 3,796 % fällig am 25.05.2048 (a) | 39.477 | 7.853 | 0,01 |
| 4,213 % fällig am 25.08.2033 | 335 | 359 | 0,00 |
| 4,246 % fällig am 25.04.2037 (a) | 352 | 12 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 25.09.2040 | 6.593 | 7.132 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 25.12.2042 (a) | 317 | 57 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.05.2034 - 25.08.2037 | 26 | 27 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.05.2033 - 25.05.2038 | 100 | 129 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.12.2023 - 01.05.2038 | 1 | 0 | 0,00 |
| 6,287 % fällig am 25.05.2041 | 75 | 96 | 0,00 |
| 25,174 % fällig am 25.07.2037 | 16 | 28 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.06.2031 - 01.03.2032 | 1.001 | 1.010 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.11.2024 - 01.11.2048 | 52.455 | 53.279 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| 3,500 % fällig am 01.08.2045 - 01.06.2049 | $ 1.247.209 | $ 1.281.260 | 1,75 |
| 3,500 % fällig am 01.02.2048 - 01.07.2049 (m) | 315.577 | 324.777 | 0,44 |
| 4,000 % fällig am 01.11.2023 - 01.06.2049 | 969.228 | 1.008.711 | 1,38 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2048 (m) | 301.498 | 311.685 | 0,43 |
| 4,500 % fällig am 01.09.2033 - 01.05.2041 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.06.2024 - 01.02.2049 | 9.064 | 9.619 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 01.06.2022 - 01.10.2038 | 4 | 3 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 01.07.2022 - 01.10.2039 | 3 | 2 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 01.05.2022 - 01.10.2030 | 3 | 2 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 01.12.2022 - 01.03.2030 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 2,500 % fällig am 01.08.2034 | 41.000 | 41.276 | 0,06 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2034 - 01.09.2049 | 1.813.050 | 1.828.079 | 2,50 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 3.320.360 | 3.394.303 | 4,64 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 8.348.250 | 8.628.125 | 11,78 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2049 | 60.300 | 63.750 | 0,09 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 0,790 % fällig am 25.03.2020 (a) | 43.700 | 127 | 0,00 |
| 0,890 % fällig am 25.01.2023 (a) | 25.376 | 584 | 0,00 |
| 0,969 % fällig am 25.04.2029 (a) | 43.000 | 3.067 | 0,00 |
| 1,089 % fällig am 25.01.2020 (a) | 130.866 | 350 | 0,00 |
| 1,257 % fällig am 25.06.2021 (a) | 6.746 | 121 | 0,00 |
| 1,425 % fällig am 25.11.2019 (a) | 8.046 | 23 | 0,00 |
| 1,520 % fällig am 25.11.2019 (a) | 80.811 | 292 | 0,00 |
| 1,686 % fällig am 25.07.2019 (a) | 2.967 | 0 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 15.09.2027 (a) | 4.454 | 303 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 15.12.2027 | 12.156 | 847 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 15.12.2032 - 15.12.2042 (a) | 7.716 | 1.160 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 01.11.2046 - 01.06.2049 | 157.944 | 159.544 | 0,22 |
| 3,500 % fällig am 01.11.2025 - 01.05.2049 | 62.417 | 64.127 | 0,09 |
| 3,500 % fällig am 15.12.2032 - 15.01.2043 (a) | 9.281 | 1.344 | 0,00 |
| 3,806 % fällig am 15.01.2042 (a) | 671 | 96 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 15.08.2020 (a) | 55 | 1 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2025 - 01.06.2049 | 430.073 | 445.495 | 0,61 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2048 (m) | 208.938 | 216.346 | 0,30 |
| 4,097 % fällig am 25.10.2052 | 94.281 | 103.869 | 0,14 |
| 4,106 % fällig am 25.11.2052 | 155.585 | 171.378 | 0,23 |
| 4,356 % fällig am 15.03.2037 (a) | 161 | 20 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.04.2023 - 01.05.2049 | 306.547 | 325.243 | 0,44 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2049 (m) | 215.817 | 229.128 | 0,31 |
| 5,112 % fällig am 15.01.2041 | 725 | 855 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.08.2033 - 01.04.2036 | 1 | 0 | 0,00 |
| 5,855 % fällig am 15.10.2033 | 1.039 | 1.141 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 01.02.2032 - 01.09.2038 | 3 | 3 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 01.04.2023 - 01.06.2037 | 13 | 10 | 0,00 |
| **Freddie Mac UMBS** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.10.2047 - 01.07.2049 | 799.824 | 820.002 | 1,12 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2048 - 01.04.2049 (m) | $ 878.781 | $ 900.189 | 1,23 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2048 - 01.03.2049 | 619.084 | 640.965 | 0,88 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2049 | 4.230 | 4.488 | 0,01 |
| **Freddie Mac, TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.06.2049 | 1.000 | 1.034 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 0,000 % fällig am 16.05.2050 (a) | 5.946 | 7 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 20.07.2045 | 67.012 | 68.811 | 0,09 |
| 2,917 % fällig am 20.08.2066 | 1.403 | 1.403 | 0,00 |
| 3,077 % fällig am 20.04.2062 | 1.421 | 1.424 | 0,00 |
| 3,107 % fällig am 20.01.2062 | 49 | 50 | 0,00 |
| 3,167 % fällig am 20.08.2066 | 11.102 | 11.146 | 0,02 |
| 3,267 % fällig am 20.06.2066 | 15.706 | 15.831 | 0,02 |
| 3,317 % fällig am 20.07.2066 | 4.682 | 4.729 | 0,01 |
| 3,387 % fällig am 20.07.2065 | 22.185 | 22.448 | 0,03 |
| 3,487 % fällig am 20.06.2067 | 43.415 | 44.235 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2043 (a) | 3.828 | 419 | 0,00 |
| 3,524 % fällig am 20.07.2067 | 24.965 | 25.438 | 0,04 |
| 3,628 % fällig am 20.09.2067 | 22.754 | 23.160 | 0,03 |
| 3,756 % fällig am 16.01.2043 (a) | 2.946 | 325 | 0,00 |
| 4,734 % fällig am 20.12.2040 | 4.977 | 5.391 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.07.2033 | 1 | 1 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2038 - 20.06.2049 | 2.008 | 2.111 | 0,00 |
| 5,120 % fällig am 20.12.2040 | 377 | 420 | 0,00 |
| 5,274 % fällig am 20.09.2066 | 15.005 | 16.444 | 0,02 |
| 5,342 % fällig am 20.09.2066 | 32.453 | 35.630 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 15.06.2023 - 15.09.2037 | 12 | 15 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 15.05.2023 - 15.05.2038 | 8 | 4 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 20.11.2022 - 20.01.2030 | 2 | 1 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 20.06.2022 - 15.05.2032 | 1 | 1 | 0,00 |
| 8,500 % fällig am 15.07.2021 - 15.01.2031 | 1 | 0 | 0,00 |
| 14,935 % fällig am 20.04.2037 | 17 | 25 | 0,00 |
| | | 21.374.328 | 29,18 |

## US-SCHATZOBLIGATIONEN

| | | | |
|---|---|---|---|
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.08.2048 | 81.815 | 89.744 | 0,12 |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049 | 38.179 | 41.939 | 0,06 |
| 3,125 % fällig am 15.02.2043 | 17.082 | 19.053 | 0,03 |
| 3,125 % fällig am 15.05.2048 | 55.840 | 62.671 | 0,09 |
| 3,625 % fällig am 15.02.2044 | 1.800 | 2.175 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 15.11.2043 | 25.750 | 31.704 | 0,04 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (h)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 | 8.074 | 7.990 | 0,01 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 | 12 | 12 | 0,00 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | 32 | 32 | 0,00 |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 | 447 | 449 | 0,00 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | 22 | 22 | 0,00 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | 469.645 | 489.537 | 0,67 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 (m) | 54.251 | 53.731 | 0,07 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | 200.555 | 211.189 | 0,29 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 9 | 10 | 0,00 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 | 237.263 | 265.216 | 0,36 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 1,250 % fällig am 31.07.2023 | 13.600 | 13.340 | 0,02 |
| 1,375 % fällig am 31.08.2023 | 203.480 | 200.531 | 0,27 |
| 1,500 % fällig am 15.08.2026 | 56.200 | 54.773 | 0,07 |
| 1,625 % fällig am 15.02.2026 | 64.337 | 63.408 | 0,09 |
| 1,750 % fällig am 15.05.2023 | 174.400 | 174.533 | 0,24 |
| 1,875 % fällig am 31.01.2022 | 1.147.900 | 1.152.115 | 1,57 |
| 2,000 % fällig am 30.04.2024 | 32.260 | 32.616 | 0,04 |
| 2,000 % fällig am 30.06.2024 | 1.940.800 | 1.962.103 | 2,68 |
| 2,000 % fällig am 15.02.2025 | 276.700 | 279.581 | 0,38 |
| 2,000 % fällig am 15.08.2025 | 281.600 | 284.350 | 0,39 |
| 2,000 % fällig am 15.11.2026 | 121.900 | 122.850 | 0,17 |
| 2,125 % fällig am 29.02.2024 | 897.100 | 912.011 | 1,25 |
| 2,125 % fällig am 31.07.2024 | 391.500 | 398.237 | 0,54 |
| 2,125 % fällig am 30.09.2024 | 79.900 | 81.267 | 0,11 |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | $ 333.596 | $ 339.297 | 0,46 |
| 2,250 % fällig am 31.12.2023 | 723.650 | 739.367 | 1,01 |
| 2,250 % fällig am 31.10.2024 | 2.072.400 | 2.121.053 | 2,90 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | 557.430 | 570.974 | 0,78 |
| 2,250 % fällig am 15.02.2027 | 262.600 | 269.155 | 0,37 |
| 2,250 % fällig am 15.08.2027 | 124.600 | 127.644 | 0,17 |
| 2,375 % fällig am 15.08.2024 | 14.600 | 15.031 | 0,02 |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 (m) | 450.600 | 465.702 | 0,64 |
| 2,625 % fällig am 31.01.2026 | 1.177.400 | 1.233.533 | 1,68 |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 (m) | 178.330 | 188.079 | 0,26 |
| 2,750 % fällig am 15.11.2023 | 505.700 | 527.074 | 0,72 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2028 | 500 | 537 | 0,00 |
| | | 13.604.635 | 18,57 |

## NON-AGENCY-MBS

| | | | |
|---|---|---|---|
| **20 Times Square Trust** | | | |
| 3,203 % fällig am 15.05.2035 | 54.000 | 54.463 | 0,08 |
| **Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.08.2036 | 10.889 | 6.176 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.06.2037 | 6.355 | 6.162 | 0,01 |
| 2,744 % fällig am 25.05.2036 | 6.825 | 3.856 | 0,01 |
| 2,924 % fällig am 25.01.2036 | 552 | 551 | 0,00 |
| 2,944 % fällig am 25.02.2036 | 317 | 223 | 0,00 |
| 3,260 % fällig am 25.08.2035 | 841 | 668 | 0,00 |
| 3,554 % fällig am 25.01.2035^ | 3.340 | 2.902 | 0,00 |
| 3,554 % fällig am 25.03.2035 | 3.240 | 3.061 | 0,00 |
| 4,199 % fällig am 25.09.2035 | 6.233 | 5.124 | 0,01 |
| 4,398 % fällig am 25.04.2035 | 20 | 20 | 0,00 |
| 4,629 % fällig am 25.01.2036 | 894 | 775 | 0,00 |
| 4,641 % fällig am 25.05.2036^ | 247 | 245 | 0,00 |
| 4,944 % fällig am 25.03.2037 | 1.611 | 1.558 | 0,00 |
| 5,728 % fällig am 25.11.2037^ | 1.156 | 1.038 | 0,00 |
| **AFG Trust** | | | |
| 2,198 % fällig am 10.10.2050 | AUD 14.596 | 10.244 | 0,01 |
| **Aggregator of Loans Backed by Assets PLC** | | | |
| 1,972 % fällig am 24.04.2049 | £ 8.039 | 10.264 | 0,01 |
| **Alliance Bancorp Trust** | | | |
| 2,644 % fällig am 25.07.2037 | $ 1.698 | 1.550 | 0,00 |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.10.2046 | 10.039 | 9.543 | 0,01 |
| 2,529 % fällig am 25.03.2047 | 2.911 | 2.693 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046^ | 4.392 | 4.197 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.10.2046 | 18.911 | 14.814 | 0,02 |
| 3,204 % fällig am 25.02.2047 | 26.209 | 16.459 | 0,02 |
| 3,424 % fällig am 25.11.2046 | 38.152 | 19.309 | 0,03 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,444 % fällig am 25.10.2046 | $ | 6.435 | $ 5.803 | 0,01 |
| 4,357 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 2.673 | 2.387 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2046 | | 12.769 | 11.536 | 0,02 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.05.2047 | | 3.260 | 2.423 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.03.2046 | | 16.132 | 15.652 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.11.2045 | | 11.247 | 10.367 | 0,02 |
| 2,764 % fällig am 25.12.2046 | | 12.626 | 12.077 | 0,02 |
| 2,804 % fällig am 25.03.2046 | | 6.237 | 6.096 | 0,01 |
| 3,004 % fällig am 25.09.2045 | | 2.342 | 2.270 | 0,00 |
| 3,229 % fällig am 25.02.2045 | | 10.343 | 9.783 | 0,01 |
| 4,185 % fällig am 25.09.2035 | | 4.934 | 3.298 | 0,01 |
| 5,383 % fällig am 25.09.2035 | | 20.113 | 15.232 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2047 | | 745 | 723 | 0,00 |
| 6,950 % fällig am 25.06.2036 | | 7.975 | 2.917 | 0,00 |
| **APS Resecuritization Trust** | | | | |
| 3,097 % fällig am 27.06.2049 | | 2.326 | 1.961 | 0,00 |
| **AyT Hipotecario Mixto FTA** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.09.2035 | € | 199 | 226 | 0,00 |
| **BAMLL Re-REMIC Trust** | | | | |
| 6,012 % fällig am 17.06.2050 | $ | 1.652 | 1.581 | 0,00 |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 3.597 | 2.928 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2020 | | 383 | 378 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 382 | 376 | 0,00 |
| 5,913 % fällig am 25.10.2036 | | 13.873 | 7.772 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 458 | 443 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 700 | 672 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 | | 2.979 | 2.742 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 ^ | | 1.117 | 1.091 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 2.936 | 2.874 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 4.399 | 4.318 | 0,01 |
| **Banc of America Funding Corp.** | | | | |
| 4,476 % fällig am 25.09.2048 | | 4.440 | 4.524 | 0,01 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 3.940 | 3.339 | 0,01 |
| 2,504 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 6.185 | 5.184 | 0,01 |
| 2,543 % fällig am 20.02.2047 | | 8.066 | 7.863 | 0,01 |
| 2,556 % fällig am 26.10.2036 | | 17.852 | 16.289 | 0,02 |
| 2,570 % fällig am 27.08.2036 | | 17.216 | 15.220 | 0,02 |
| 2,573 % fällig am 20.10.2036 | | 4.774 | 4.292 | 0,01 |
| 2,573 % fällig am 20.10.2046 ^ | | 2.140 | 2.009 | 0,00 |
| 2,593 % fällig am 20.04.2047 ^ | | 1.532 | 1.399 | 0,00 |
| 2,593 % fällig am 20.06.2047 | | 1.069 | 975 | 0,00 |
| 2,612 % fällig am 26.05.2037 | | 8.349 | 7.379 | 0,01 |
| 2,633 % fällig am 20.05.2035 | | 1.959 | 1.957 | 0,00 |
| 2,663 % fällig am 20.06.2047 | | 4.394 | 4.037 | 0,01 |
| 2,683 % fällig am 20.05.2047 | | 3.079 | 2.971 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.07.2037 | | 405 | 389 | 0,00 |
| 2,690 % fällig am 26.07.2036 | | 6.761 | 5.898 | 0,01 |
| 2,694 % fällig am 25.05.2037 | | 8.877 | 7.673 | 0,01 |
| 2,694 % fällig am 25.07.2037 | | 3.983 | 3.813 | 0,01 |
| 2,804 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 2.165 | 1.886 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 436 | 380 | 0,00 |
| 3,752 % fällig am 20.07.2047 ^ | | 1.281 | 1.032 | 0,00 |
| 4,151 % fällig am 20.05.2035 ^ | | 2.014 | 1.829 | 0,00 |
| 4,225 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 346 | 337 | 0,00 |
| 4,267 % fällig am 20.09.2046 ^ | | 205 | 192 | 0,00 |
| 4,328 % fällig am 20.07.2036 | | 6.898 | 7.174 | 0,01 |
| 4,364 % fällig am 20.09.2035 ^ | | 2.097 | 1.972 | 0,00 |
| 4,429 % fällig am 20.05.2036 ^ | | 584 | 578 | 0,00 |
| 4,618 % fällig am 20.02.2036 ^ | | 112 | 111 | 0,00 |
| 4,624 % fällig am 20.11.2035 ^ | | 478 | 470 | 0,00 |
| 4,637 % fällig am 20.05.2036 ^ | | 757 | 758 | 0,00 |
| 4,648 % fällig am 20.01.2047 ^ | | 4.529 | 4.404 | 0,01 |
| 4,664 % fällig am 20.11.2034 | | 92 | 91 | 0,00 |
| 4,694 % fällig am 29.04.2037 | | 7.115 | 5.675 | 0,01 |
| 4,997 % fällig am 20.06.2032 | | 7 | 7 | 0,00 |
| 5,035 % fällig am 20.07.2036 | | 299 | 304 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2036 | | 158 | 141 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 133 | 127 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 | | 3 | 4 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 | | 362 | 370 | 0,00 |
| 5,763 % fällig am 25.10.2036 | | 399 | 386 | 0,00 |
| 5,773 % fällig am 25.05.2037 | | 166 | 164 | 0,00 |
| 5,846 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 360 | 360 | 0,00 |
| 5,847 % fällig am 25.01.2037 | | 1.123 | 1.124 | 0,00 |
| 5,979 % fällig am 25.10.2036 | | 831 | 803 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 1.176 | 1.128 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 | | 729 | 724 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 1.806 | 1.746 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 3.988 | 3.774 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 26.10.2037 | $ | 2.912 | $ 2.806 | 0,00 |
| 10,390 % fällig am 26.07.2035 | | 339 | 375 | 0,00 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | |
| 3,835 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.090 | 898 | 0,00 |
| 4,373 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 206 | 192 | 0,00 |
| 4,452 % fällig am 20.11.2046 ^ | | 448 | 441 | 0,00 |
| 4,560 % fällig am 20.10.2046 ^ | | 995 | 937 | 0,00 |
| 4,677 % fällig am 25.02.2036 | | 1.821 | 1.503 | 0,00 |
| 4,871 % fällig am 25.02.2034 | | 63 | 64 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 1.353 | 1.283 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 | | 387 | 355 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 49 | 48 | 0,00 |
| **Bancorp Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,244 % fällig am 15.08.2032 | | 5.730 | 5.724 | 0,01 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 26.08.2036 (f) | | 1.527 | 815 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.04.2037 | | 4.069 | 3.977 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.03.2037 | | 14.602 | 14.442 | 0,02 |
| 2,594 % fällig am 25.10.2036 | | 159 | 146 | 0,00 |
| 2,600 % fällig am 26.01.2037 | | 10.362 | 9.518 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.04.2037 | | 161 | 158 | 0,00 |
| 2,637 % fällig am 26.07.2036 | | 1.490 | 1.456 | 0,00 |
| 2,640 % fällig am 26.07.2046 | | 3.746 | 3.719 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.02.2047 | | 2.399 | 2.327 | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 26.06.2046 | | 1.400 | 1.395 | 0,00 |
| 3,054 % fällig am 25.09.2047 | | 2.128 | 2.016 | 0,00 |
| 3,297 % fällig am 26.11.2046 | | 4.490 | 4.527 | 0,01 |
| 3,597 % fällig am 26.07.2037 | | 7.818 | 6.379 | 0,01 |
| 3,604 % fällig am 25.10.2047 | | 4.249 | 4.015 | 0,01 |
| 3,636 % fällig am 27.01.2037 | | 198 | 198 | 0,00 |
| 3,998 % fällig am 26.07.2037 | | 2.354 | 2.070 | 0,00 |
| 4,220 % fällig am 26.02.2036 | | 5.990 | 6.030 | 0,01 |
| 4,254 % fällig am 26.08.2036 | | 5.720 | 5.753 | 0,01 |
| 4,300 % fällig am 26.04.2047 | | 6.297 | 6.095 | 0,01 |
| 4,935 % fällig am 26.03.2037 | | 606 | 616 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 26.05.2037 | | 3.918 | 2.948 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 26.02.2036 | | 1.764 | 1.450 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 26.10.2036 | | 3.511 | 3.515 | 0,01 |
| 6,227 % fällig am 26.08.2036 | | 4.629 | 3.146 | 0,01 |
| 7,409 % fällig am 26.08.2037 | | 9.063 | 7.975 | 0,01 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | |
| 3,820 % fällig am 25.03.2035 | | 22 | 22 | 0,00 |
| 3,976 % fällig am 25.08.2047 ^ | | 3.090 | 2.816 | 0,00 |
| 4,050 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 232 | 223 | 0,00 |
| 4,190 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 847 | 838 | 0,00 |
| 4,258 % fällig am 25.10.2046 | | 3.428 | 3.245 | 0,01 |
| 4,286 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 5.152 | 4.922 | 0,01 |
| 4,292 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 448 | 426 | 0,00 |
| 4,392 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 684 | 648 | 0,00 |
| 4,447 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 2.326 | 2.152 | 0,00 |
| 4,517 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 61 | 64 | 0,00 |
| 4,533 % fällig am 25.07.2034 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 4,607 % fällig am 25.10.2033 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 4,792 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 11.449 | 10.645 | 0,02 |
| 4,795 % fällig am 25.10.2035 | | 1.540 | 1.573 | 0,00 |
| 4,899 % fällig am 25.02.2047 | | 4.763 | 4.700 | 0,01 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 2,744 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 34.178 | 37.563 | 0,05 |
| 2,744 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 3.639 | 3.209 | 0,01 |
| 2,844 % fällig am 25.04.2035 | | 218 | 219 | 0,00 |
| 2,844 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 6.345 | 7.368 | 0,01 |
| 2,884 % fällig am 25.02.2036 | | 2.991 | 2.921 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 1.644 | 1.755 | 0,00 |
| 2,944 % fällig am 25.10.2035 | | 12.377 | 12.357 | 0,02 |
| 3,044 % fällig am 25.04.2034 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 3,104 % fällig am 25.10.2035 | | 1.440 | 1.263 | 0,00 |
| 3,529 % fällig am 25.01.2035 | | 4.287 | 4.005 | 0,01 |
| 3,824 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 2.530 | 2.397 | 0,00 |
| 3,913 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 460 | 409 | 0,00 |
| 3,915 % fällig am 25.08.2046 ^ | | 7.193 | 6.960 | 0,01 |
| 3,987 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 7.419 | 6.227 | 0,01 |
| 4,001 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 1.661 | 1.697 | 0,00 |
| 4,016 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 2.731 | 1.862 | 0,00 |
| 4,097 % fällig am 25.09.2047 | | 28.174 | 23.601 | 0,03 |
| 4,153 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 3.225 | 2.228 | 0,00 |
| 4,178 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 6.134 | 3.884 | 0,01 |
| 4,284 % fällig am 25.09.2034 | | 643 | 636 | 0,00 |
| 4,324 % fällig am 25.01.2047 | | 1.024 | 801 | 0,00 |
| 4,496 % fällig am 25.09.2035 | | 3.500 | 3.331 | 0,01 |
| 4,544 % fällig am 25.10.2033 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 4,566 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 417 | 309 | 0,00 |
| 4,623 % fällig am 25.07.2035 | | 1.851 | 1.805 | 0,00 |
| 4,625 % fällig am 25.05.2035 | | 172 | 175 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.10.2034 | $ | 111 | $ 96 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 4.795 | 2.931 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2035 | | 3.497 | 3.020 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 | | 330 | 339 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2034 ^ | | 2.835 | 2.864 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 | | 1.546 | 1.296 | 0,00 |
| **Bear Stearns Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 6,035 % fällig am 13.02.2042 | | 1.000 | 1.014 | 0,00 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.03.2037 | | 4.932 | 4.741 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.12.2046 | | 6.529 | 6.354 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.06.2047 | | 5.743 | 5.527 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.06.2047 | | 13.805 | 13.318 | 0,02 |
| 2,584 % fällig am 25.10.2036 | | 2.313 | 2.200 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.01.2037 | | 4.157 | 4.083 | 0,01 |
| 2,604 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 17.483 | 18.615 | 0,03 |
| 2,604 % fällig am 25.09.2047 | | 12.677 | 12.112 | 0,02 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | | |
| 3,801 % fällig am 26.12.2046 ^ | | 3.469 | 3.008 | 0,00 |
| 4,284 % fällig am 26.01.2036 ^ | | 3.801 | 3.377 | 0,01 |
| **BellaVista Mortgage Trust** | | | | |
| 3,124 % fällig am 22.01.2045 | | 1.025 | 1.031 | 0,00 |
| **BNPP Mortgage Securities LLC Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 27.08.2037 | | 2.356 | 948 | 0,00 |
| **Brunel Residential Mortgage Securitisation PLC** | | | | |
| 1,041 % fällig am 13.01.2039 | £ | 76.190 | 95.192 | 0,13 |
| **Business Mortgage Finance PLC** | | | | |
| 0,069 % fällig am 15.08.2040 | € | 683 | 770 | 0,00 |
| **BX Trust** | | | | |
| 3,274 % fällig am 15.07.2034 | $ | 42.707 | 42.762 | 0,06 |
| 3,314 % fällig am 15.07.2034 | | 14.492 | 14.497 | 0,02 |
| **BXP Trust** | | | | |
| 3,379 % fällig am 13.06.2039 | | 90.000 | 94.479 | 0,13 |
| **Caesars Palace Las Vegas Trust** | | | | |
| 4,499 % fällig am 15.10.2034 | | 55.300 | 57.459 | 0,08 |
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 2,078 % fällig am 01.06.2020 | CAD | 22.853 | 17.492 | 0,02 |
| 2,278 % fällig am 01.07.2020 | | 64.060 | 49.132 | 0,07 |
| 2,278 % fällig am 01.08.2020 | | 22.126 | 16.957 | 0,02 |
| **Cascade Funding Mortgage Trust** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.10.2068 | $ | 26.366 | 26.959 | 0,04 |
| **CGGS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,294 % fällig am 15.02.2037 | | 17.040 | 17.034 | 0,02 |
| 3,744 % fällig am 15.02.2037 | | 6.790 | 6.803 | 0,01 |
| 4,694 % fällig am 15.02.2037 | | 12.620 | 12.665 | 0,02 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 3,799 % fällig am 25.07.2037 | | 1.102 | 1.004 | 0,00 |
| 4,044 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 1.715 | 1.700 | 0,00 |
| 4,167 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 207 | 201 | 0,00 |
| 4,206 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 11.730 | 11.352 | 0,02 |
| 4,239 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 2.166 | 2.173 | 0,00 |
| 4,357 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 664 | 658 | 0,00 |
| 4,493 % fällig am 25.02.2037 | | 468 | 485 | 0,00 |
| 4,643 % fällig am 25.07.2037 | | 187 | 144 | 0,00 |
| 4,719 % fällig am 25.02.2037 | | 3.724 | 3.890 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 25.05.2035 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 4.536 | 4.438 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | | 4.653 | 3.760 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 1.334 | 1.002 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 3.526 | 2.757 | 0,00 |
| **ChaseFlex Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 11.550 | 12.259 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.07.2037 | | 11.838 | 10.658 | 0,02 |
| 2,734 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 1.139 | 985 | 0,00 |
| 4,648 % fällig am 25.09.2036 | | 1.122 | 1.114 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 2.286 | 1.868 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2035 | | 4.229 | 4.250 | 0,01 |
| **Chester A PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.03.2046 (l) | £ | 210.391 | 262.352 | 0,36 |
| **Chester Downs & Marina LLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 20.05.2046 | | 1 | 16.937 | 0,02 |
| **Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.01.2036 | $ | 795 | 792 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.05.2036 | | 1.560 | 1.568 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.01.2036 | | 2.169 | 2.171 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.10.2036 | | 1.851 | 1.794 | 0,00 |
| 2,634 % fällig am 25.10.2035 | | 2.526 | 2.534 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.08.2035 | | 2.084 | 2.094 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| 2,674 % fällig am 25.05.2035 | $ 1.884 | $ 1.861 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.01.2035 | 1.540 | 1.520 | 0,00 |
| 2,694 % fällig am 25.10.2035 | 902 | 912 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.08.2035 | 346 | 349 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.05.2035 | 519 | 515 | 0,00 |
| 2,764 % fällig am 25.03.2035 | 430 | 428 | 0,00 |
| 2,917 % fällig am 25.08.2035 | 1.775 | 1.262 | 0,00 |
| 3,084 % fällig am 25.10.2034 | 1.446 | 1.405 | 0,00 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 0,457 % fällig am 10.03.2047 (a) | 25.416 | 372 | 0,00 |
| 3,494 % fällig am 15.07.2030 | 13.470 | 13.396 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,534 % fällig am 25.06.2036 | 6.637 | 5.409 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2036 | 1.427 | 1.397 | 0,00 |
| 2,570 % fällig am 25.08.2036 | 11.699 | 5.843 | 0,01 |
| 2,590 % fällig am 25.09.2036 | 1.515 | 1.519 | 0,00 |
| 3,592 % fällig am 25.03.2037 ^ | 905 | 771 | 0,00 |
| 3,997 % fällig am 25.10.2035 ^ | 227 | 210 | 0,00 |
| 4,076 % fällig am 25.03.2037 ^ | 7.307 | 6.536 | 0,01 |
| 4,097 % fällig am 20.02.2036 | 3.505 | 3.390 | 0,01 |
| 4,109 % fällig am 25.09.2064 | 20.283 | 20.148 | 0,03 |
| 4,126 % fällig am 25.04.2036 | 415 | 338 | 0,00 |
| 4,129 % fällig am 25.08.2047 ^ | 603 | 554 | 0,00 |
| 4,145 % fällig am 25.01.2082 | 41.736 | 42.077 | 0,06 |
| 4,291 % fällig am 25.09.2037 | 5.766 | 5.621 | 0,01 |
| 4,301 % fällig am 25.11.2036 | 1.672 | 1.334 | 0,00 |
| 4,422 % fällig am 25.11.2036 ^ | 6.290 | 5.971 | 0,01 |
| 4,494 % fällig am 25.07.2036 ^ | 276 | 232 | 0,00 |
| 4,509 % fällig am 25.07.2037 ^ | 3.570 | 3.571 | 0,01 |
| 4,545 % fällig am 25.06.2036 ^ | 5.748 | 5.598 | 0,01 |
| 4,552 % fällig am 25.08.2035 ^ | 1.397 | 1.251 | 0,00 |
| 4,626 % fällig am 25.03.2037 ^ | 3.446 | 3.429 | 0,01 |
| 4,741 % fällig am 25.04.2037 ^ | 657 | 664 | 0,00 |
| 4,875 % fällig am 25.07.2036 ^ | 3.937 | 3.361 | 0,01 |
| 4,909 % fällig am 25.05.2042 | 2.753 | 2.814 | 0,00 |
| 4,984 % fällig am 25.03.2036 ^ | 1.017 | 1.018 | 0,00 |
| 5,036 % fällig am 25.07.2036 ^ | 868 | 878 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 | 2.233 | 2.315 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 | 3.295 | 3.352 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 | 143 | 152 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | 2.344 | 1.805 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 3,853 % fällig am 25.08.2035 | 3.625 | 2.974 | 0,00 |
| 4,403 % fällig am 25.05.2035 | 140 | 143 | 0,00 |
| 4,639 % fällig am 25.12.2035 ^ | 1.075 | 930 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.11.2035 ^ | 5.103 | 4.377 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 4,243 % fällig am 25.09.2035 ^ | 2.991 | 2.802 | 0,00 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,904 % fällig am 25.05.2037 | 8.872 | 7.326 | 0,01 |
| 2,954 % fällig am 25.01.2037 | 9.579 | 7.916 | 0,01 |
| 2,954 % fällig am 25.02.2037 ^ | 3.037 | 2.415 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.03.2037 | 5.234 | 4.227 | 0,01 |
| 3,054 % fällig am 25.12.2036 | 2.361 | 1.902 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.12.2036 ^ | 3.927 | 3.732 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2037 | 4.256 | 4.167 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 | 364 | 350 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | 446 | 443 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 | 5.906 | 5.744 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 917 | 911 | 0,00 |
| **Civic Mortgage LLC** | | | |
| 4,349 % fällig am 25.11.2022 | 5.233 | 5.230 | 0,01 |
| **CLNS Trust** | | | |
| 3,212 % fällig am 11.06.2032 | 17.400 | 17.425 | 0,02 |
| **Commercial Mortgage Pass-Through Certificates** | | | |
| 3,651 % fällig am 10.02.2049 | 15.066 | 15.730 | 0,02 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 0,243 % fällig am 10.04.2047 (a) | 58.900 | 495 | 0,00 |
| 1,333 % fällig am 10.08.2046 (a) | 22.420 | 808 | 0,00 |
| 1,592 % fällig am 10.10.2049 (a) | 78.195 | 5.872 | 0,01 |
| 1,806 % fällig am 15.08.2045 (a) | 66.455 | 2.759 | 0,00 |
| 3,140 % fällig am 10.10.2036 | 10.000 | 10.308 | 0,01 |
| 3,505 % fällig am 10.08.2048 | 11.000 | 11.620 | 0,02 |
| 3,961 % fällig am 10.05.2051 | 40.000 | 43.629 | 0,06 |
| 5,904 % fällig am 10.06.2044 | 2.525 | 2.578 | 0,00 |
| **Countrywide** | | | |
| 5,693 % fällig am 27.11.2035 | 9 | 10 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust** | | | |
| 4,484 % fällig am 25.03.2047 | 8.529 | 8.344 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | 454 | 370 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 | $ 1.720 | $ 1.387 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | 322 | 145 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.06.2036 | 3.713 | 3.531 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.12.2046 | 1.371 | 1.326 | 0,00 |
| 2,534 % fällig am 25.03.2047 ^ | 8.769 | 7.220 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.08.2037 | 13.970 | 13.019 | 0,02 |
| 2,544 % fällig am 25.04.2047 | 6.810 | 6.521 | 0,01 |
| 2,563 % fällig am 20.02.2047 ^ | 3.096 | 2.458 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2047 | 7.244 | 7.140 | 0,01 |
| 2,573 % fällig am 20.03.2047 | 9.873 | 8.572 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.11.2036 | 973 | 947 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.06.2046 | 2.103 | 2.046 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.07.2046 | 1.431 | 1.395 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.05.2047 | 6.590 | 6.315 | 0,01 |
| 2,578 % fällig am 20.12.2046 ^ | 16.206 | 14.670 | 0,02 |
| 2,579 % fällig am 25.11.2036 | 10.493 | 9.591 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.09.2046 | 3.906 | 3.527 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.06.2047 | 8.549 | 7.448 | 0,01 |
| 2,593 % fällig am 20.03.2046 | 10.129 | 9.388 | 0,01 |
| 2,593 % fällig am 20.05.2046 ^ | 28.679 | 24.235 | 0,03 |
| 2,594 % fällig am 25.07.2046 ^ | 3.866 | 3.603 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.08.2046 | 26.912 | 23.257 | 0,03 |
| 2,604 % fällig am 25.05.2036 | 7.165 | 6.377 | 0,01 |
| 2,613 % fällig am 20.07.2035 | 3.440 | 3.392 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.07.2046 | 8.338 | 8.128 | 0,01 |
| 2,634 % fällig am 25.03.2036 | 6.770 | 5.758 | 0,01 |
| 2,634 % fällig am 25.11.2036 ^ | 8.882 | 7.295 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.06.2037 | 8.182 | 6.488 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.07.2046 | 3.784 | 3.086 | 0,00 |
| 2,663 % fällig am 20.09.2046 | 7.678 | 4.702 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.07.2036 | 5.502 | 4.556 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.02.2037 | 8.985 | 8.344 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.10.2046 | 4.470 | 4.418 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.08.2047 ^ | 12.121 | 10.660 | 0,02 |
| 2,694 % fällig am 25.02.2036 ^ | 2.182 | 1.854 | 0,00 |
| 2,698 % fällig am 25.05.2035 ^ | 4.551 | 3.300 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.08.2035 ^ | 520 | 420 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.11.2035 ^ | 1.450 | 457 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.12.2035 | 2.582 | 2.345 | 0,00 |
| 2,713 % fällig am 20.11.2035 | 18.621 | 18.282 | 0,03 |
| 2,714 % fällig am 25.08.2035 ^ | 3.113 | 2.781 | 0,00 |
| 2,724 % fällig am 25.11.2035 | 1.313 | 1.230 | 0,00 |
| 2,744 % fällig am 25.09.2035 | 925 | 751 | 0,00 |
| 2,754 % fällig am 25.09.2035 | 9.587 | 9.460 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.05.2036 ^ | 3.161 | 1.949 | 0,00 |
| 2,754 % fällig am 25.10.2036 ^ | 2.578 | 1.577 | 0,00 |
| 2,774 % fällig am 25.02.2037 ^ | 1.055 | 372 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.12.2036 ^ | 4.327 | 1.198 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.04.2037 ^ | 2.655 | 1.109 | 0,00 |
| 2,854 % fällig am 25.09.2035 ^ | 3.124 | 2.445 | 0,00 |
| 2,884 % fällig am 25.07.2035 | 4.217 | 3.787 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.05.2035 ^ | 5.977 | 5.223 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.06.2035 ^ | 6.700 | 5.644 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.07.2036 ^ | 3.755 | 2.456 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.09.2036 | 184 | 123 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.05.2037 ^ | 2.597 | 1.372 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.05.2037 | 235 | 159 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.09.2037 | 1.252 | 766 | 0,00 |
| 2,924 % fällig am 25.07.2035 | 2.323 | 2.284 | 0,00 |
| 2,924 % fällig am 25.12.2035 | 401 | 400 | 0,00 |
| 2,944 % fällig am 25.01.2036 | 4.548 | 4.440 | 0,01 |
| 2,954 % fällig am 25.08.2035 ^ | 6.108 | 5.045 | 0,01 |
| 2,964 % fällig am 25.08.2035 | 6.889 | 6.642 | 0,01 |
| 2,983 % fällig am 20.11.2035 | 3.831 | 3.720 | 0,01 |
| 2,984 % fällig am 25.05.2034 | 127 | 128 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.01.2036 | 2.280 | 2.251 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.10.2036 | 918 | 530 | 0,00 |
| 3,023 % fällig am 20.11.2035 | 2.619 | 2.455 | 0,00 |
| 3,104 % fällig am 25.02.2036 | 6.024 | 4.621 | 0,01 |
| 3,104 % fällig am 25.05.2036 | 6.142 | 3.572 | 0,01 |
| 3,154 % fällig am 25.01.2036 ^ | 145 | 111 | 0,00 |
| 3,204 % fällig am 25.12.2035 ^ | 713 | 630 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.12.2036 ^ | 1.102 | 542 | 0,00 |
| 3,354 % fällig am 25.11.2046 | 1.573 | 1.432 | 0,00 |
| 3,444 % fällig am 25.06.2046 | 11.139 | 10.115 | 0,01 |
| 3,445 % fällig am 25.09.2034 | 90 | 94 | 0,00 |
| 3,504 % fällig am 25.12.2035 | 2.253 | 2.191 | 0,00 |
| 3,504 % fällig am 25.02.2036 | 264 | 249 | 0,00 |
| 3,504 % fällig am 25.02.2036 ^ | 134 | 116 | 0,00 |
| 3,814 % fällig am 20.07.2035 ^ | 207 | 199 | 0,00 |
| 3,884 % fällig am 25.11.2047 ^ | 10.062 | 8.997 | 0,01 |
| 3,904 % fällig am 25.08.2035 | 1.505 | 1.509 | 0,00 |
| 4,003 % fällig am 25.03.2047 ^ | $ 2.281 | $ 2.034 | 0,00 |
| 4,075 % fällig am 25.06.2037 ^ | 17.602 | 15.160 | 0,02 |
| 4,096 % fällig am 25.09.2037 (a) | 1.252 | 274 | 0,00 |
| 4,104 % fällig am 25.08.2035 ^ | 3.469 | 3.171 | 0,01 |
| 4,127 % fällig am 25.07.2021 ^ | 70 | 68 | 0,00 |
| 4,149 % fällig am 25.06.2035 | 3.311 | 3.167 | 0,01 |
| 4,193 % fällig am 25.03.2047 | 1.417 | 1.363 | 0,00 |
| 4,209 % fällig am 25.09.2034 ^ | 4.812 | 4.471 | 0,01 |
| 4,271 % fällig am 25.10.2035 ^ | 809 | 709 | 0,00 |
| 4,364 % fällig am 25.11.2035 | 11.886 | 12.161 | 0,02 |
| 4,546 % fällig am 25.10.2037 ^(a) | 2.034 | 593 | 0,00 |
| 4,601 % fällig am 25.04.2036 ^ | 739 | 687 | 0,00 |
| 4,775 % fällig am 25.12.2034 | 42 | 44 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 25.06.2035 ^ | 1.037 | 984 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.04.2035 | 4.343 | 4.422 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2035 | 2.522 | 2.561 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 ^ | 1.423 | 1.252 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 ^ | 568 | 541 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | 8.837 | 8.560 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | 6.254 | 5.524 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | 20 | 17 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 | 10.587 | 9.534 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | 6.938 | 6.900 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2036 ^ | 1.798 | 1.736 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2036 | 3.229 | 3.133 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.02.2036 ^ | 2.905 | 2.613 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.04.2036 | 1.282 | 1.265 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.04.2037 ^ | 780 | 623 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2035 ^ | 196 | 175 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2036 | 4.652 | 3.265 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2036 ^ | 7.562 | 5.231 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 | 4.076 | 3.990 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 ^ | 4.915 | 4.160 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 ^ | 1.551 | 1.329 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2027 ^ | 162 | 169 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2034 | 1.399 | 1.381 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2035 | 3.313 | 3.272 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2035 ^ | 89 | 64 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 ^ | 7.403 | 7.166 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | 3.962 | 3.813 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 ^ | 9.167 | 6.568 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 | 2.497 | 2.111 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | 72 | 54 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.08.2036 ^ | 2.905 | 2.477 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | 26.999 | 25.329 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | 3.006 | 2.578 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | 4.503 | 3.933 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | 2.188 | 1.141 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | 2.254 | 2.050 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | 15.023 | 9.606 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 | 2.263 | 1.407 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | 2.440 | 1.517 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | 4.081 | 3.410 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | 11.960 | 8.593 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | 8.771 | 6.260 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | 23.109 | 18.890 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2047 ^ | 3.123 | 2.543 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.11.2036 ^ | 552 | 425 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2032 | 68 | 70 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | 11.386 | 7.755 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 25.10.2036 ^ | 1.549 | 769 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.10.2037 | 7.314 | 4.339 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 25.07.2036 | 3.227 | 2.990 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 3,124 % fällig am 25.11.2035 | 355 | 356 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,604 % fällig am 25.04.2046 | 2.979 | 2.597 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.03.2036 | 5.974 | 5.822 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.05.2036 | 582 | 334 | 0,00 |
| 2,741 % fällig am 25.02.2035 | 4.615 | 4.123 | 0,01 |
| 2,744 % fällig am 25.04.2046 | 8.422 | 3.966 | 0,01 |
| 2,804 % fällig am 25.09.2037 ^ | 6.219 | 4.375 | 0,01 |
| 2,844 % fällig am 25.05.2035 ^ | 33 | 25 | 0,00 |
| 2,862 % fällig am 25.04.2035 ^ | 4.866 | 4.063 | 0,01 |
| 2,984 % fällig am 25.04.2035 | 263 | 248 | 0,00 |
| 3,024 % fällig am 25.03.2035 | 200 | 192 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | 2.848 | 2.755 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.02.2035 | 4.325 | 3.984 | 0,01 |
| 3,104 % fällig am 25.02.2035 | 5.242 | 4.925 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 25.03.2035 | 1.466 | 1.200 | 0,00 |
| 3,144 % fällig am 25.02.2035 | 4.759 | 4.558 | 0,01 |
| 3,164 % fällig am 25.09.2034 | 269 | 270 | 0,00 |
| 3,433 % fällig am 25.05.2047 | 7.306 | 6.582 | 0,01 |

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

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,526 % fällig am 20.02.2036 | $ | 4.904 | $ 4.191 | 0,01 |
| 3,565 % fällig am 20.01.2035 | | 127 | 127 | 0,00 |
| 3,844 % fällig am 20.09.2036 ^ | | 4.236 | 3.723 | 0,01 |
| 3,883 % fällig am 20.06.2036 | | 3.602 | 3.219 | 0,01 |
| 3,927 % fällig am 25.08.2034 ^ | | 122 | 117 | 0,00 |
| 3,932 % fällig am 20.05.2036 ^ | | 2.449 | 2.376 | 0,00 |
| 4,034 % fällig am 20.03.2036 | | 857 | 805 | 0,00 |
| 4,040 % fällig am 25.11.2037 | | 4.392 | 3.955 | 0,01 |
| 4,082 % fällig am 20.09.2035 | | 203 | 175 | 0,00 |
| 4,126 % fällig am 20.06.2035 | | 67 | 68 | 0,00 |
| 4,209 % fällig am 20.04.2036 | | 1.291 | 1.207 | 0,00 |
| 4,241 % fällig am 20.12.2035 | | 698 | 623 | 0,00 |
| 4,255 % fällig am 20.12.2035 | | 129 | 126 | 0,00 |
| 4,260 % fällig am 20.02.2036 | | 649 | 601 | 0,00 |
| 4,278 % fällig am 20.10.2034 | | 802 | 777 | 0,00 |
| 4,356 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 599 | 594 | 0,00 |
| 4,442 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 3.681 | 3.637 | 0,01 |
| 4,547 % fällig am 25.08.2034 ^ | | 1.254 | 1.200 | 0,00 |
| 4,667 % fällig am 20.02.2036 ^ | | 3.138 | 2.916 | 0,00 |
| 4,741 % fällig am 20.10.2034 | | 449 | 416 | 0,00 |
| 4,775 % fällig am 20.04.2035 | | 251 | 256 | 0,00 |
| 4,796 % fällig am 25.05.2036 (a) | | 582 | 148 | 0,00 |
| 4,991 % fällig am 20.07.2034 | | 319 | 308 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.05.2035 | | 1.249 | 1.183 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.591 | 1.604 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 1.721 | 1.524 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 1.025 | 962 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 2.427 | 2.115 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.06.2037 | | 3.258 | 2.774 | 0,00 |
| 5,850 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 455 | 366 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 | | 2.193 | 1.821 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | | 3.873 | 3.150 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 5.132 | 4.339 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 80 | 71 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 | | 2.372 | 1.948 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 4.984 | 4.253 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 | | 2.315 | 1.988 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 1.258 | 1.035 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | | 3.581 | 2.945 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 13.312 | 10.300 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 51 | 42 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 | | 1.521 | 1.138 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 | | 3.201 | 2.909 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2038 ^ | | 10.843 | 8.916 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 795 | 618 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037 | | 6.306 | 4.837 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 4,946 % fällig am 25.01.2034 ^ | | 31 | 30 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2035 ^ | | 637 | 644 | 0,00 |
| **Countrywide MBS, Inc.** | | | | |
| 5,945 % fällig am 27.11.2035 | | 1.728 | 1.650 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 3,136 % fällig am 25.06.2046 | | 102.374 | 106.666 | 0,15 |
| 4,637 % fällig am 25.03.2033 | | 150 | 150 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 1.277 | 1.224 | 0,00 |
| 5,466 % fällig am 15.05.2023 | | 1.022 | 1.030 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | | 2.165 | 2.140 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 | | 2.536 | 1.986 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 655 | 538 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 1.310 | 450 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 4.986 | 1.630 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-through Certificates** | | | | |
| 4,553 % fällig am 25.10.2033 | | 7 | 7 | 0,00 |
| 5,397 % fällig am 25.07.2035 | | 4.830 | 5.168 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 2,540 % fällig am 27.12.2036 | | 1.532 | 1.512 | 0,00 |
| 2,570 % fällig am 27.10.2036 | | 13.830 | 11.009 | 0,02 |
| 2,590 % fällig am 27.12.2037 | | 6.045 | 5.726 | 0,01 |
| 2,600 % fällig am 27.11.2036 | | 19.420 | 20.659 | 0,03 |
| 2,780 % fällig am 27.02.2046 | | 11.124 | 5.125 | 0,01 |
| 2,977 % fällig am 30.11.2037 | | 2.625 | 2.619 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 27.06.2037 | | 5.490 | 5.539 | 0,01 |
| 3,090 % fällig am 27.12.2035 | | 2.805 | 2.794 | 0,00 |
| 3,751 % fällig am 26.08.2036 | | 9.007 | 8.293 | 0,01 |
| 3,819 % fällig am 27.07.2037 | | 1.432 | 1.350 | 0,00 |
| 4,081 % fällig am 27.02.2036 | | 4.884 | 4.674 | 0,01 |
| 4,112 % fällig am 27.11.2037 | | 5.809 | 5.744 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 27.01.2036 | | 9.799 | 9.518 | 0,01 |
| 4,343 % fällig am 26.06.2036 | | 10.732 | 10.311 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 26.12.2035 | | 932 | 912 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 2.621 | 2.507 | 0,00 |
| 7,786 % fällig am 27.07.2037 | | 1.989 | 1.842 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.08.2036 ^ | $ | 2.572 | $ 2.483 | 0,00 |
| 5,896 % fällig am 25.04.2036 | | 446 | 338 | 0,00 |
| 5,942 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.310 | 627 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2021 ^ | | 29 | 26 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 1.914 | 1.421 | 0,00 |
| 6,421 % fällig am 25.10.2037 | | 7.893 | 7.159 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | |
| 3,144 % fällig am 15.07.2032 | | 48.000 | 48.029 | 0,07 |
| 3,269 % fällig am 25.07.2057 | | 165.891 | 151.247 | 0,21 |
| 3,344 % fällig am 15.02.2031 | | 12.360 | 12.320 | 0,02 |
| 3,393 % fällig am 25.07.2057 (a) | | 5.303 | 4.758 | 0,01 |
| 3,394 % fällig am 15.07.2032 | | 22.200 | 22.214 | 0,03 |
| 3,453 % fällig am 25.07.2058 | | 428.012 | 397.963 | 0,54 |
| 3,482 % fällig am 25.09.2048 (a) | | 20.042 | 18.618 | 0,03 |
| 3,652 % fällig am 25.06.2048 | | 103.668 | 102.140 | 0,14 |
| 3,726 % fällig am 25.10.2058 (a) | | 1.000 | 1.003 | 0,00 |
| 3,834 % fällig am 25.04.2058 | | 131.608 | 135.604 | 0,19 |
| 3,981 % fällig am 27.03.2036 | | 2.621 | 2.652 | 0,00 |
| 4,294 % fällig am 25.12.2048 | | 59.145 | 60.533 | 0,08 |
| 4,495 % fällig am 25.12.2048 | | 23.506 | 23.587 | 0,03 |
| 4,548 % fällig am 01.06.2050 | | 367.169 | 377.950 | 0,52 |
| 4,724 % fällig am 25.09.2057 (a) | | 2.523 | 2.578 | 0,00 |
| **DBUBS Mortgage Trust** | | | | |
| 0,885 % fällig am 10.11.2046 (a) | | 17.533 | 104 | 0,00 |
| 1,229 % fällig am 10.07.2044 (a) | | 12.196 | 188 | 0,00 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.041 | 986 | 0,00 |
| 2,534 % fällig am 25.08.2047 | | 1.091 | 1.048 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.07.2047 | | 18.799 | 17.881 | 0,03 |
| 2,554 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 11.527 | 10.883 | 0,02 |
| 2,564 % fällig am 25.03.2037 | | 20.869 | 13.175 | 0,02 |
| 2,574 % fällig am 25.02.2037 | | 4.226 | 4.159 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 15 | 14 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.01.2047 | | 4.786 | 4.394 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 20.670 | 9.974 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.12.2036 | | 2.827 | 1.574 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 5.280 | 4.859 | 0,01 |
| 2,604 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 4 | 2 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.08.2047 | | 4.741 | 4.526 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.06.2037 | | 3.733 | 3.633 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.01.2047 | | 4.445 | 3.850 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.08.2036 | | 7.009 | 6.757 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 20.622 | 18.682 | 0,03 |
| 2,734 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 25.241 | 21.897 | 0,03 |
| 2,794 % fällig am 25.11.2035 | | 2.761 | 2.581 | 0,00 |
| 3,504 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 546 | 519 | 0,00 |
| 4,081 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 575 | 554 | 0,00 |
| 4,379 % fällig am 25.10.2035 | | 4.739 | 4.646 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 5,257 % fällig am 25.06.2036 | | 478 | 467 | 0,00 |
| 5,257 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 32 | 31 | 0,00 |
| 5,945 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 6.453 | 6.472 | 0,01 |
| 6,005 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 2.750 | 2.643 | 0,00 |
| **Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 27.07.2037 | | 1.003 | 935 | 0,00 |
| **Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,405 % fällig am 25.06.2034 | | 2.539 | 2.572 | 0,00 |
| **Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates** | | | | |
| 3,821 % fällig am 27.06.2037 | | 1.074 | 1.103 | 0,00 |
| **Dilosk RMBS DAC** | | | | |
| 0,520 % fällig am 20.10.2057 | € | 20.000 | 22.823 | 0,03 |
| **Domi BV** | | | | |
| 0,553 % fällig am 15.06.2051 | | 23.000 | 26.215 | 0,04 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,580 % fällig am 19.10.2036 | $ | 11.185 | 10.008 | 0,01 |
| 2,590 % fällig am 19.10.2036 | | 5.629 | 5.360 | 0,01 |
| 2,680 % fällig am 19.10.2045 | | 34 | 33 | 0,00 |
| 3,210 % fällig am 19.09.2044 | | 18 | 18 | 0,00 |
| **Dragon Finance BV** | | | | |
| 1,911 % fällig am 13.07.2023 | £ | 6.796 | 8.395 | 0,01 |
| **Dukinfield PLC** | | | | |
| 1,806 % fällig am 15.08.2045 | | 8.550 | 10.912 | 0,02 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,368 % fällig am 28.01.2048 | € | 63.435 | 72.392 | 0,10 |
| **Epic Drummond Ltd.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.01.2022 | | 1.343 | 1.522 | 0,00 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | | |
| 1,136 % fällig am 15.09.2044 | £ | 8.750 | $ 9.853 | 0,01 |
| 1,386 % fällig am 15.09.2044 | | 7.250 | 7.803 | 0,01 |
| **European Loan Conduit** | | | | |
| 1,000 % fällig am 23.04.2029 (c) | € | 25.000 | 28.484 | 0,04 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | | 5.997 | 6.381 | 0,01 |
| 0,127 % fällig am 10.09.2044 | | 4.000 | 4.106 | 0,01 |
| 0,949 % fällig am 13.03.2045 | £ | 29 | 36 | 0,00 |
| 1,236 % fällig am 10.09.2044 | | 4.000 | 4.612 | 0,01 |
| 1,559 % fällig am 13.09.2045 | | 20.748 | 25.066 | 0,04 |
| 1,739 % fällig am 13.06.2045 | | 3.594 | 4.544 | 0,01 |
| 1,789 % fällig am 13.06.2045 | | 2.155 | 2.570 | 0,00 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,443 % fällig am 12.09.2065 | | 57.444 | 73.050 | 0,10 |
| 1,910 % fällig am 16.06.2069 | | 39.000 | 49.759 | 0,07 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.07.2036 ^ | $ | 5.022 | 2.996 | 0,00 |
| 3,104 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 2.678 | 1.744 | 0,00 |
| 4,010 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 330 | 320 | 0,00 |
| 4,093 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 507 | 382 | 0,00 |
| 4,116 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 1.817 | 1.659 | 0,00 |
| 4,120 % fällig am 25.03.2035 | | 1.557 | 1.285 | 0,00 |
| 4,177 % fällig am 25.02.2036 | | 188 | 159 | 0,00 |
| 4,225 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 4.091 | 3.609 | 0,01 |
| 4,301 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 1.725 | 1.403 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 25.05.2020 ^ | | 2 | 2 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | | 135 | 118 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 1.193 | 925 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.117 | 832 | 0,00 |
| **First Horizon Asset Securities, Inc.** | | | | |
| 4,511 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 66 | 55 | 0,00 |
| **First Horizon Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,721 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 915 | 782 | 0,00 |
| 3,989 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 695 | 572 | 0,00 |
| 4,422 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 1.053 | 1.027 | 0,00 |
| 4,623 % fällig am 25.09.2035 | | 14 | 14 | 0,00 |
| 4,769 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 624 | 496 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | | 335 | 276 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 501 | 411 | 0,00 |
| **First Mortgage Co.** | | | | |
| 4,190 % fällig am 15.12.2024 (l) | £ | 298 | 0 | 0,00 |
| **FirstMac Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,418 % fällig am 08.03.2049 | AUD | 16.981 | 11.880 | 0,02 |
| **Fondo de Titulizacion de Activos UCI** | | | | |
| 0,000 % fällig am 16.06.2049 | € | 16.013 | 17.418 | 0,02 |
| **GC Pastor Hipotecario FTA** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.06.2046 | | 2.477 | 2.476 | 0,00 |
| **GE Commercial Mortgage Corp. Trust** | | | | |
| 5,540 % fällig am 10.12.2049 | $ | 683 | 575 | 0,00 |
| **GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.** | | | | |
| 5,456 % fällig am 10.03.2051 | | 19.135 | 19.934 | 0,03 |
| 5,550 % fällig am 10.08.2038 | | 21.781 | 22.375 | 0,03 |
| **GMAC Commercial Mortgage Securities, Inc.** | | | | |
| 5,044 % fällig am 10.12.2041 ^ | | 4.646 | 4.649 | 0,01 |
| **GMAC Mortgage Corp. Loan Trust** | | | | |
| 4,073 % fällig am 19.11.2035 ^ | | 94 | 91 | 0,00 |
| 4,210 % fällig am 19.04.2036 ^ | | 206 | 189 | 0,00 |
| 4,718 % fällig am 18.03.2035 | | 96 | 99 | 0,00 |
| 5,117 % fällig am 19.07.2035 | | 281 | 263 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2035 | | 1.706 | 1.692 | 0,00 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,911 % fällig am 18.03.2039 | £ | 13.608 | 17.004 | 0,02 |
| 0,931 % fällig am 18.06.2038 | | 12.263 | 15.319 | 0,02 |
| 2,532 % fällig am 18.06.2039 | $ | 735 | 715 | 0,00 |
| **Great Wolf Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2018 (a) | | 71.000 | 1 | 0,00 |
| 3,244 % fällig am 15.09.2034 | | 8.300 | 8.312 | 0,01 |
| **Grecale RMBS SRL** | | | | |
| 0,188 % fällig am 27.01.2061 | € | 904 | 1.029 | 0,00 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.10.2046 | $ | 14.433 | 14.161 | 0,02 |
| 2,614 % fällig am 25.01.2047 | | 1.835 | 1.708 | 0,00 |
| 2,844 % fällig am 25.06.2045 | | 1.483 | 1.412 | 0,00 |
| 2,924 % fällig am 25.10.2045 | | 6.404 | 6.520 | 0,01 |
| 2,984 % fällig am 25.02.2036 | | 4.474 | 4.521 | 0,01 |
| 3,024 % fällig am 25.10.2045 | | 3.827 | 3.546 | 0,01 |
| **Grifonas Finance PLC** | | | | |
| 0,050 % fällig am 28.08.2039 | € | 15.592 | 16.607 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **GS Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 1,657 % fällig am 10.02.2046 (a) | $ | 32.421 | $ | 1.484 | 0,00 |
| 3,419 % fällig am 10.10.2032 | | 26.700 | | 27.568 | 0,04 |
| 4,744 % fällig am 10.10.2032 | | 35.288 | | 35.229 | 0,05 |
| **GSC Capital Corp. Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 3.443 | | 3.360 | 0,01 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.03.2035 | | 10.489 | | 9.802 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.09.2035 | | 11.042 | | 9.850 | 0,01 |
| 2,804 % fällig am 25.06.2034 | | 769 | | 736 | 0,00 |
| 4,178 % fällig am 25.06.2034 | | 7.448 | | 7.387 | 0,01 |
| 7,109 % fällig am 20.10.2032 | | 2.110 | | 2.179 | 0,00 |
| **GSMSC Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,493 % fällig am 25.07.2035 | | 1 | | 1 | 0,00 |
| **GSMSC Resecuritization Trust** | | | | | |
| 2,600 % fällig am 26.08.2033 | | 2.715 | | 2.686 | 0,00 |
| 2,610 % fällig am 26.09.2036 | | 12.394 | | 9.696 | 0,01 |
| 4,606 % fällig am 26.08.2035 | | 956 | | 1.014 | 0,00 |
| 5,515 % fällig am 26.04.2037 | | 8.545 | | 3.046 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,040 % fällig am 25.05.2034 | | 98 | | 98 | 0,00 |
| 4,218 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 6.150 | | 5.205 | 0,01 |
| 4,270 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 2.473 | | 2.151 | 0,00 |
| 4,335 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 311 | | 282 | 0,00 |
| 4,396 % fällig am 25.01.2036 | | 2.172 | | 2.198 | 0,00 |
| 4,789 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 715 | | 683 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | | 1.099 | | 1.163 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 565 | | 605 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 915 | | 1.128 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | | 3.478 | | 2.939 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 4.451 | | 3.860 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 818 | | 731 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 | | 1.555 | | 925 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.05.2036 | | 1.457 | | 823 | 0,00 |
| **Harben Finance PLC** | | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | £ | 18.686 | | 23.760 | 0,03 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,520 % fällig am 19.03.2037 | $ | 2.001 | | 1.956 | 0,00 |
| 2,540 % fällig am 25.01.2047 | | 20.744 | | 20.427 | 0,03 |
| 2,560 % fällig am 19.12.2036 ^ | | 1.743 | | 1.619 | 0,00 |
| 2,570 % fällig am 19.11.2036 | | 2.277 | | 2.288 | 0,00 |
| 2,570 % fällig am 19.11.2046 ^ | | 1.929 | | 1.660 | 0,00 |
| 2,580 % fällig am 19.09.2037 | | 17.191 | | 16.720 | 0,02 |
| 2,580 % fällig am 19.01.2038 | | 25.310 | | 24.347 | 0,03 |
| 2,600 % fällig am 19.11.2036 | | 31.083 | | 28.367 | 0,04 |
| 2,663 % fällig am 20.10.2045 | | 8.271 | | 7.194 | 0,01 |
| 2,700 % fällig am 19.11.2035 | | 601 | | 577 | 0,00 |
| 2,830 % fällig am 19.05.2035 | | 6.697 | | 6.511 | 0,01 |
| 2,910 % fällig am 19.06.2034 | | 5 | | 5 | 0,00 |
| 2,930 % fällig am 19.03.2035 | | 1.687 | | 1.666 | 0,00 |
| 2,990 % fällig am 19.04.2034 | | 306 | | 297 | 0,00 |
| 3,030 % fällig am 19.08.2045 | | 5.199 | | 5.126 | 0,01 |
| 3,070 % fällig am 19.01.2035 | | 392 | | 382 | 0,00 |
| 3,404 % fällig am 25.10.2037 | | 24.708 | | 25.230 | 0,04 |
| 3,930 % fällig am 19.02.2036 | | 3.149 | | 2.837 | 0,00 |
| 4,004 % fällig am 19.09.2035 ^ | | 303 | | 283 | 0,00 |
| 4,354 % fällig am 19.06.2036 ^ | | 3.528 | | 2.353 | 0,00 |
| 4,408 % fällig am 19.11.2034 | | 713 | | 732 | 0,00 |
| 4,504 % fällig am 19.10.2035 | | 10.578 | | 8.423 | 0,01 |
| 4,504 % fällig am 19.01.2036 ^ | | 1.355 | | 914 | 0,00 |
| 4,908 % fällig am 19.12.2035 ^ | | 2.272 | | 2.263 | 0,00 |
| 5,004 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 259 | | 171 | 0,00 |
| **Hawksmoor Mortgages PLC** | | | | | |
| 2,195 % fällig am 25.05.2053 | £ | 53.990 | | 68.837 | 0,09 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.07.2035 | $ | 11 | | 11 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.01.2036 | | 3.310 | | 3.324 | 0,01 |
| 4,146 % fällig am 25.04.2037 | | 2.745 | | 2.490 | 0,00 |
| 4,300 % fällig am 25.04.2047 | | 2.361 | | 2.252 | 0,00 |
| **HSI Asset Loan Obligation Trust** | | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.12.2036 | | 2.384 | | 875 | 0,00 |
| 4,226 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 1.878 | | 424 | 0,00 |
| **IM Pastor Fondo de Titluzacion Hipotecaria** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 22.09.2041 | € | 434 | | 492 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | | | |
| 2,944 % fällig am 25.05.2035 | $ | 508 | | 506 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 25.11.2034 | | 4.669 | | 4.709 | 0,01 |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | | 8.252 | | 8.198 | 0,01 |
| 3,084 % fällig am 25.01.2035 | | 5.892 | | 5.899 | 0,01 |
| 3,204 % fällig am 25.03.2033 | | 39 | | 39 | 0,00 |
| 6,060 % fällig am 25.10.2034 | | 685 | | 763 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Impac Secured Assets Corp.** | | | | | |
| 2,724 % fällig am 25.03.2036 | $ | 3.062 | $ | 2.640 | 0,00 |
| 3,829 % fällig am 25.02.2035 | | 1.000 | | 1.005 | 0,00 |
| **Impac Secured Assets Trust** | | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 1.980 | | 1.702 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 5.009 | | 4.718 | 0,01 |
| 2,604 % fällig am 25.11.2036 | | 8.084 | | 7.658 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 6.237 | | 5.413 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.01.2037 | | 20.516 | | 17.582 | 0,02 |
| 2,674 % fällig am 25.11.2036 | | 7.140 | | 5.507 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 7.348 | | 6.310 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.05.2036 | | 1.877 | | 1.896 | 0,00 |
| 2,764 % fällig am 25.09.2037 | | 5.319 | | 4.642 | 0,01 |
| **IMT Trust** | | | | | |
| 3,094 % fällig am 15.06.2034 | | 22.400 | | 22.196 | 0,03 |
| **IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 3,909 % fällig am 25.01.2032 | | 1 | | 1 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.07.2036 | | 8.969 | | 8.313 | 0,01 |
| 2,534 % fällig am 25.10.2036 | | 5.519 | | 5.249 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 3.810 | | 3.693 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 10.639 | | 10.344 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.07.2047 | | 6.552 | | 5.596 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.10.2036 | | 7.802 | | 4.920 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.04.2037 | | 2.278 | | 2.141 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.06.2046 | | 12.073 | | 10.658 | 0,02 |
| 2,604 % fällig am 25.11.2046 | | 13.136 | | 12.284 | 0,02 |
| 2,614 % fällig am 25.11.2036 | | 318 | | 308 | 0,00 |
| 2,614 % fällig am 25.05.2046 | | 14.547 | | 14.225 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.09.2037 | | 222 | | 213 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.10.2036 | | 3.178 | | 2.026 | 0,00 |
| 2,694 % fällig am 25.01.2036 | | 4.778 | | 4.039 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.07.2035 | | 15 | | 14 | 0,00 |
| 2,754 % fällig am 25.06.2036 | | 5.093 | | 4.837 | 0,01 |
| 2,804 % fällig am 25.07.2046 | | 7.096 | | 5.736 | 0,01 |
| 2,864 % fällig am 25.04.2035 | | 870 | | 824 | 0,00 |
| 2,924 % fällig am 25.07.2035 | | 9.730 | | 8.606 | 0,01 |
| 3,184 % fällig am 25.12.2034 | | 1.339 | | 1.187 | 0,00 |
| 3,224 % fällig am 25.11.2034 ^ | | 1.946 | | 1.728 | 0,00 |
| 3,264 % fällig am 25.09.2034 | | 80 | | 78 | 0,00 |
| 3,343 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 3.129 | | 2.752 | 0,00 |
| 3,347 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 341 | | 326 | 0,00 |
| 3,432 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 6.159 | | 5.739 | 0,01 |
| 3,502 % fällig am 25.07.2037 | | 10.972 | | 10.396 | 0,01 |
| 3,621 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 227 | | 201 | 0,00 |
| 3,680 % fällig am 25.04.2037 | | 6.159 | | 5.754 | 0,01 |
| 3,718 % fällig am 25.06.2036 | | 10.602 | | 8.901 | 0,01 |
| 3,730 % fällig am 25.07.2036 | | 5.714 | | 4.982 | 0,01 |
| 3,754 % fällig am 25.08.2037 | | 4.218 | | 3.605 | 0,01 |
| 3,786 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 7.149 | | 6.246 | 0,01 |
| 3,823 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 348 | | 305 | 0,00 |
| 3,835 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 9.794 | | 8.369 | 0,01 |
| 3,861 % fällig am 25.04.2037 | | 12.031 | | 11.405 | 0,02 |
| 3,914 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 101 | | 82 | 0,00 |
| 3,924 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 3.073 | | 2.468 | 0,00 |
| 3,925 % fällig am 25.08.2036 | | 300 | | 296 | 0,00 |
| 3,926 % fällig am 25.08.2035 | | 118 | | 107 | 0,00 |
| 3,931 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 58 | | 47 | 0,00 |
| 3,981 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 6.002 | | 5.523 | 0,01 |
| 3,989 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 470 | | 421 | 0,00 |
| 4,013 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 490 | | 415 | 0,00 |
| 4,048 % fällig am 25.09.2036 | | 2.874 | | 2.604 | 0,00 |
| 4,099 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 2.818 | | 2.714 | 0,00 |
| 4,127 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 349 | | 339 | 0,00 |
| 4,134 % fällig am 25.12.2035 | | 6.794 | | 6.239 | 0,01 |
| 4,264 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 36 | | 35 | 0,00 |
| 4,381 % fällig am 25.08.2034 | | 154 | | 154 | 0,00 |
| 4,490 % fällig am 25.09.2037 | | 22.797 | | 21.689 | 0,03 |
| 4,676 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 681 | | 661 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 1.166 | | 1.147 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 255 | | 181 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | | 1.027 | | 730 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 377 | | 225 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 2.270 | | 1.936 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2037 | | 3.544 | | 3.028 | 0,00 |
| **InTown Hotel Portfolio Trust** | | | | | |
| 3,444 % fällig am 15.01.2033 | | 6.700 | | 6.703 | 0,01 |
| 3,644 % fällig am 15.01.2033 | | 7.700 | | 7.670 | 0,01 |
| 4,444 % fällig am 15.01.2033 | | 20.900 | | 20.781 | 0,03 |
| **JPMorgan Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.03.2037 | | 1.009 | | 1.484 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 1.453 | | 1.457 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 2,684 % fällig am 25.04.2047 | $ | 8.843 | $ | 8.608 | 0,01 |
| 2,924 % fällig am 25.01.2036 | | 162 | | 162 | 0,00 |
| 3,722 % fällig am 25.10.2036 | | 9.647 | | 8.553 | 0,01 |
| 3,877 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 1.841 | | 1.799 | 0,00 |
| 4,171 % fällig am 25.03.2036 | | 1.451 | | 1.355 | 0,00 |
| 4,226 % fällig am 25.01.2036 | | 656 | | 550 | 0,00 |
| 5,658 % fällig am 26.05.2037 | | 5.516 | | 4.734 | 0,01 |
| 5,710 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 1.146 | | 1.103 | 0,00 |
| 5,960 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 3.661 | | 3.462 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 27.12.2036 | | 1.787 | | 1.477 | 0,00 |
| 6,050 % fällig am 25.05.2036 | | 883 | | 857 | 0,00 |
| 6,120 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.534 | | 1.478 | 0,00 |
| 6,180 % fällig am 25.03.2036 | | 7.575 | | 7.240 | 0,01 |
| 6,420 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 4.226 | | 3.259 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 3,194 % fällig am 15.06.2032 | | 3.356 | | 3.349 | 0,01 |
| 3,194 % fällig am 15.02.2035 | | 35.550 | | 35.549 | 0,05 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 1,403 % fällig am 15.04.2046 (a) | | 17.359 | | 709 | 0,00 |
| 1,746 % fällig am 15.05.2045 (a) | | 19.478 | | 725 | 0,00 |
| 3,244 % fällig am 15.10.2032 | | 11.723 | | 11.644 | 0,02 |
| 3,881 % fällig am 05.01.2031 | | 18.000 | | 18.645 | 0,03 |
| 5,337 % fällig am 15.05.2047 | | 3.265 | | 3.050 | 0,00 |
| 5,615 % fällig am 12.09.2037 | | 4.184 | | 4.033 | 0,01 |
| 5,927 % fällig am 12.01.2038 | | 2.000 | | 2.010 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | | | |
| 3,722 % fällig am 27.07.2037 | | 1.045 | | 1.070 | 0,00 |
| 4,103 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 8 | | 7 | 0,00 |
| 4,151 % fällig am 25.10.2036 | | 599 | | 536 | 0,00 |
| 4,152 % fällig am 25.05.2037 | | 3.086 | | 3.029 | 0,00 |
| 4,193 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 1.756 | | 1.698 | 0,00 |
| 4,200 % fällig am 25.05.2036 | | 3.634 | | 3.604 | 0,01 |
| 4,222 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 1.828 | | 1.785 | 0,00 |
| 4,222 % fällig am 25.11.2035 | | 6.038 | | 5.897 | 0,01 |
| 4,281 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 7.462 | | 7.274 | 0,01 |
| 4,301 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 198 | | 194 | 0,00 |
| 4,320 % fällig am 25.08.2035 | | 2.491 | | 2.495 | 0,00 |
| 4,335 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 839 | | 767 | 0,00 |
| 4,447 % fällig am 25.09.2035 | | 1.413 | | 1.454 | 0,00 |
| 4,462 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 104 | | 101 | 0,00 |
| 4,494 % fällig am 25.06.2034 | | 28 | | 29 | 0,00 |
| 4,517 % fällig am 25.08.2036 | | 248 | | 208 | 0,00 |
| 4,542 % fällig am 25.07.2035 | | 409 | | 415 | 0,00 |
| 4,652 % fällig am 25.04.2035 ^ | | 454 | | 464 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2036 | | 5.779 | | 5.061 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 25.06.2021 ^ | | 204 | | 194 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2022 ^ | | 171 | | 171 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 7.579 | | 6.062 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | | 4.129 | | 3.302 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2037 | | 6.189 | | 3.764 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.01.2035 | | 2.659 | | 2.995 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 298 | | 217 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2036 | | 6.306 | | 4.598 | 0,01 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | | |
| 3,327 % fällig am 26.05.2037 | | 4.899 | | 4.124 | 0,01 |
| 4,045 % fällig am 27.09.2036 | | 49 | | 50 | 0,00 |
| 4,716 % fällig am 26.09.2036 | | 1.946 | | 1.955 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 26.04.2037 | | 2.498 | | 2.029 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 26.05.2037 | | 200 | | 151 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 26.09.2036 | | 1.171 | | 1.072 | 0,00 |
| 6,025 % fällig am 26.09.2037 | | 1.913 | | 1.486 | 0,00 |
| **Kensington Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 0,051 % fällig am 14.06.2040 | € | 2.098 | | 2.340 | 0,00 |
| **Kirkby RMBS PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 22.02.2045 | £ | 1 | | 5.046 | 0,01 |
| 1,603 % fällig am 22.02.2045 | | 58.218 | | 72.486 | 0,10 |
| 2,250 % fällig am 22.02.2045 | | 4.258 | | 3.953 | 0,01 |
| 2,803 % fällig am 22.02.2045 | | 13.150 | | 16.261 | 0,02 |
| **Landmark Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 0,986 % fällig am 17.06.2039 | | 4.251 | | 5.073 | 0,01 |
| **Lansdowne Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.06.2045 | € | 6.319 | | 6.751 | 0,01 |
| **LB-UBS Commercial Mortgage Trust** | | | | | |
| 5,407 % fällig am 15.11.2038 ^ | $ | 5.039 | | 3.603 | 0,01 |
| 5,562 % fällig am 15.02.2040 ^ | | 4.177 | | 2.526 | 0,00 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,904 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 1.449 | | 1.223 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 1.384 | | 1.170 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2037 | | 481 | | 432 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2036 | | 3.074 | | 1.765 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 1.029 | | 797 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 | | 2.317 | | 2.305 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.12.2036 | $ | 13.358 | $ 9.871 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 | | 229 | 225 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.08.2046 | | 10.517 | 10.181 | 0,01 |
| 2,604 % fällig am 25.11.2046 ^ | | 1.458 | 1.439 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 11.179 | 9.929 | 0,01 |
| 2,609 % fällig am 25.08.2046 | | 16.233 | 16.433 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.06.2047 | | 11.853 | 10.724 | 0,02 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 152 | 147 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.08.2037 | | 8.311 | 8.215 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.02.2046 ^ | | 14.901 | 13.747 | 0,02 |
| 2,674 % fällig am 25.02.2036 | | 563 | 545 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.11.2035 | | 19.195 | 19.142 | 0,03 |
| 3,254 % fällig am 25.03.2047 | | 5.509 | 5.422 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.08.2047 ^ | | 19.724 | 17.741 | 0,03 |
| 3,554 % fällig am 25.12.2037 | | 2.290 | 2.169 | 0,00 |
| 3,940 % fällig am 25.07.2035 | | 18 | 18 | 0,00 |
| **Liberty Funding Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,618 % fällig am 10.10.2049 | AUD | 55.042 | 38.605 | 0,05 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 01.01.2061 | € | 12.168 | 13.111 | 0,02 |
| 0,389 % fällig am 01.01.2061 | | 8.647 | 9.094 | 0,01 |
| 0,983 % fällig am 01.12.2060 | £ | 1.530 | 1.852 | 0,00 |
| 1,441 % fällig am 01.01.2061 | | 27.943 | 34.225 | 0,05 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 ^ | $ | 5.446 | 4.802 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 | | 4.247 | 4.114 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.05.2046 | | 1.626 | 1.478 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.02.2046 | | 3.140 | 2.755 | 0,00 |
| 2,764 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 286 | 272 | 0,00 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 2,036 % fällig am 15.12.2049 | £ | 6.123 | 7.628 | 0,01 |
| 2,786 % fällig am 15.12.2049 | | 5.442 | 6.891 | 0,01 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | | |
| 2,954 % fällig am 25.09.2037 | $ | 9.832 | 4.389 | 0,01 |
| 3,836 % fällig am 25.03.2035 | | 754 | 601 | 0,00 |
| 3,913 % fällig am 25.02.2035 | | 274 | 262 | 0,00 |
| 4,087 % fällig am 25.03.2035 | | 212 | 206 | 0,00 |
| 4,411 % fällig am 25.03.2035 | | 81 | 62 | 0,00 |
| 4,494 % fällig am 25.09.2034 | | 1.532 | 1.215 | 0,00 |
| **MASTR Alternative Loan Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.04.2035 | | 4.054 | 4.154 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 5.214 | 4.320 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.05.2034 | | 128 | 138 | 0,00 |
| **MASTR Asset Securitization Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 4.304 | 4.166 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 | | 1.428 | 1.438 | 0,00 |
| **MASTR Reperforming Loan Trust** | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 4.639 | 3.613 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 25.08.2034 | | 15 | 15 | 0,00 |
| **MASTR Seasoned Securitization Trust** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.10.2032 | | 46 | 42 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.04.2037 | | 848 | 852 | 0,00 |
| 4,195 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 4.412 | 3.409 | 0,01 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 0,944 % fällig am 25.01.2029 (a) | | 1.467 | 16 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.04.2029 | | 1.399 | 1.395 | 0,00 |
| 2,884 % fällig am 25.08.2035 | | 7.754 | 7.465 | 0,01 |
| 3,034 % fällig am 25.08.2036 | | 4.776 | 4.018 | 0,01 |
| 3,229 % fällig am 25.11.2029 | | 2.018 | 1.929 | 0,00 |
| 3,424 % fällig am 25.09.2029 | | 363 | 359 | 0,00 |
| 4,103 % fällig am 25.05.2036 | | 9 | 8 | 0,00 |
| 4,428 % fällig am 25.12.2035 | | 6.106 | 6.112 | 0,01 |
| 4,464 % fällig am 25.11.2035 | | 213 | 219 | 0,00 |
| 4,745 % fällig am 25.12.2034 | | 297 | 311 | 0,00 |
| 4,770 % fällig am 25.01.2037 | | 261 | 260 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 15.11.2026 | | 2.050 | 2.074 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust** | | | | |
| 1,178 % fällig am 15.02.2047 (a) | | 9.173 | 306 | 0,00 |
| 3,046 % fällig am 15.04.2048 | | 40.000 | 41.191 | 0,06 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.08.2036 | | 7.906 | 3.667 | 0,01 |
| 3,529 % fällig am 25.09.2035 | | 4.063 | 4.015 | 0,01 |
| 3,544 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 138 | 100 | 0,00 |
| 3,703 % fällig am 25.11.2037 | | 11.506 | 9.858 | 0,01 |
| 4,025 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 2.533 | 2.004 | 0,00 |
| 4,184 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 82 | 72 | 0,00 |
| 4,384 % fällig am 25.09.2035 | | 1.483 | 1.477 | 0,00 |
| 4,485 % fällig am 25.06.2036 | | 2.461 | 2.554 | 0,00 |
| 4,741 % fällig am 25.08.2034 | $ | 140 | $ 141 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 528 | 537 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 1.221 | 1.262 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 | | 4.815 | 3.896 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 3.898 | 3.668 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 2.796 | 2.300 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 | | 11.162 | 9.520 | 0,01 |
| 6,354 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.522 | 578 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 134 | 106 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Re-REMIC Trust** | | | | |
| 3,824 % fällig am 26.12.2036 | | 3.569 | 3.126 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 26.11.2034 | | 78 | 82 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Resecuritization Trust** | | | | |
| 3,050 % fällig am 26.01.2051 | | 4.225 | 4.234 | 0,01 |
| 3,321 % fällig am 26.11.2046 | | 4.109 | 3.053 | 0,00 |
| 3,406 % fällig am 26.06.2047 | | 10.448 | 8.730 | 0,01 |
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | | |
| 2,880 % fällig am 25.02.2042 | | 13.973 | 12.986 | 0,02 |
| **MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.06.2047 | | 16.478 | 16.102 | 0,02 |
| 2,904 % fällig am 25.09.2037 | | 8.634 | 8.202 | 0,01 |
| **MortgageIT Trust** | | | | |
| 2,684 % fällig am 25.10.2035 | | 362 | 362 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.08.2035 | | 350 | 348 | 0,00 |
| 3,024 % fällig am 25.12.2035 | | 5.756 | 5.713 | 0,01 |
| 3,289 % fällig am 25.02.2035 | | 1.298 | 1.284 | 0,00 |
| 3,690 % fällig am 25.02.2035 | | 12 | 12 | 0,00 |
| **Mortimer BTL** | | | | |
| 2,009 % fällig am 20.06.2051 | £ | 20.000 | 25.495 | 0,04 |
| **Motel 6 Trust** | | | | |
| 3,314 % fällig am 15.08.2034 | $ | 92.740 | 92.864 | 0,13 |
| 3,584 % fällig am 15.08.2034 | | 54.121 | 54.194 | 0,07 |
| **Mulcair Securities DAC** | | | | |
| 0,695 % fällig am 24.04.2071 | € | 37.000 | 42.212 | 0,06 |
| **Natixis Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,144 % fällig am 15.02.2033 | $ | 9.400 | 9.340 | 0,01 |
| 3,494 % fällig am 15.02.2033 | | 6.710 | 6.668 | 0,01 |
| **New Century Alternative Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 5,074 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 8.196 | 3.812 | 0,01 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,500 % fällig am 25.05.2058 | | 39.163 | 41.566 | 0,06 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 0,282 % fällig am 15.12.2050 | € | 1.531 | 1.688 | 0,00 |
| 0,946 % fällig am 15.12.2050 | £ | 15.800 | 18.489 | 0,03 |
| 0,984 % fällig am 01.12.2050 | | 2.212 | 2.675 | 0,00 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.06.2037 | $ | 1.021 | 838 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.12.2035 | | 886 | 362 | 0,00 |
| 3,404 % fällig am 25.05.2035 | | 2.281 | 1.838 | 0,00 |
| 3,424 % fällig am 25.08.2034 | | 1.258 | 1.236 | 0,00 |
| 4,558 % fällig am 25.06.2036 | | 609 | 539 | 0,00 |
| 5,034 % fällig am 25.05.2035 | | 2.728 | 2.007 | 0,00 |
| 5,064 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 95 | 85 | 0,00 |
| 5,688 % fällig am 25.07.2035 | | 2.053 | 2.067 | 0,00 |
| 6,408 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 862 | 339 | 0,00 |
| **Nomura Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,408 % fällig am 26.03.2037 | | 13.320 | 8.338 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.07.2036 | | 29.645 | 29.656 | 0,04 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 1,836 % fällig am 25.09.2046 | | 16.269 | 7.895 | 0,01 |
| **OBX Trust** | | | | |
| 3,054 % fällig am 25.06.2057 | | 7.848 | 7.825 | 0,01 |
| 3,254 % fällig am 25.04.2048 | | 15.643 | 15.660 | 0,02 |
| **Oncilla Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 2,193 % fällig am 12.12.2043 | £ | 15.452 | 19.818 | 0,03 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,061 % fällig am 15.01.2039 | | 15.944 | 19.256 | 0,03 |
| 1,760 % fällig am 15.05.2045 (c) | | 60.000 | 76.415 | 0,11 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 3,330 % fällig am 18.11.2060 | $ | 46.800 | 46.871 | 0,06 |
| **PHH Alternative Mortgage Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.05.2037 | | 7.382 | 7.063 | 0,01 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,443 % fällig am 12.12.2054 | £ | 19.415 | 24.576 | 0,03 |
| **Premier Financial Planning Ltd.** | | | | |
| 3,274 % fällig am 14.07.2035 | $ | 19.412 | 19.439 | 0,03 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 165 | 166 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 509 | 479 | 0,00 |
| **Proteus RMBS DAC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 29.10.2054 | € | 14.190 | $ 11.623 | 0,02 |
| 0,143 % fällig am 29.10.2054 | | 111.138 | 126.498 | 0,17 |
| 0,593 % fällig am 29.10.2054 | | 8.681 | 9.869 | 0,01 |
| 0,793 % fällig am 29.10.2054 | | 6.313 | 7.177 | 0,01 |
| 1,443 % fällig am 29.10.2054 | | 4.735 | 5.373 | 0,01 |
| 2,693 % fällig am 29.10.2054 | | 3.946 | 4.447 | 0,01 |
| **RAIT Trust** | | | | |
| 3,344 % fällig am 15.06.2037 | $ | 1.060 | 1.051 | 0,00 |
| **RBSGC Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 901 | 554 | 0,00 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,910 % fällig am 27.06.2036 | | 1.400 | 871 | 0,00 |
| 3,824 % fällig am 26.12.2036 | | 7.137 | 7.052 | 0,01 |
| 4,714 % fällig am 26.10.2035 | | 308 | 312 | 0,00 |
| 4,808 % fällig am 26.01.2036 | | 2.575 | 2.628 | 0,00 |
| 4,938 % fällig am 26.01.2036 | | 15.837 | 16.103 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 26.05.2036 | | 2.605 | 1.989 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 26.08.2037 | | 957 | 849 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 26.10.2037 | | 4.731 | 4.560 | 0,01 |
| **Renoir CDO BV** | | | | |
| 0,540 % fällig am 07.10.2095 | € | 2.213 | 2.531 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 2,504 % fällig am 25.05.2037 | $ | 201 | 188 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 2.101 | 1.853 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | | 6.279 | 6.048 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 | | 4.382 | 3.833 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | | 4.162 | 3.929 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.07.2036 | | 2.058 | 1.935 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 8.332 | 5.271 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.07.2036 | | 2.679 | 2.523 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 3.938 | 3.744 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.07.2037 | | 8.542 | 8.384 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.05.2047 | | 2.223 | 2.167 | 0,00 |
| 2,619 % fällig am 25.05.2046 | | 4.788 | 4.608 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 4.524 | 3.389 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.02.2046 ^ | | 129 | 99 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.05.2046 ^ | | 5.489 | 4.861 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.08.2035 | | 327 | 295 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.04.2036 | | 2.594 | 2.477 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.12.2036 | | 7.755 | 5.568 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.12.2036 | | 4.523 | 3.575 | 0,01 |
| 2,764 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 3.854 | 2.881 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 307 | 236 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 6.114 | 4.769 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 64 | 56 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 8.959 | 6.703 | 0,01 |
| 3,752 % fällig am 25.11.2037 | | 830 | 772 | 0,00 |
| 3,864 % fällig am 25.09.2045 | | 830 | 782 | 0,00 |
| 4,004 % fällig am 25.08.2035 | | 3.595 | 3.468 | 0,01 |
| 4,146 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 4.184 | 828 | 0,00 |
| 4,236 % fällig am 25.01.2037 (a) | | 3.900 | 768 | 0,00 |
| 4,246 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 1.736 | 287 | 0,00 |
| 4,378 % fällig am 25.02.2035 ^ | | 747 | 655 | 0,00 |
| 4,412 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 316 | 285 | 0,00 |
| 4,609 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 743 | 699 | 0,00 |
| 4,796 % fällig am 25.12.2036 (a) | | 2.538 | 613 | 0,00 |
| 5,240 % fällig am 25.02.2035 ^ | | 595 | 413 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 2.614 | 2.483 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 2.973 | 2.814 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2037 | | 658 | 610 | 0,00 |
| 5,804 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 3.607 | 3.315 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 1.580 | 1.531 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 | | 2.032 | 2.006 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 1.069 | 1.030 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 6.046 | 5.677 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 613 | 571 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 8.980 | 8.364 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 2.002 | 1.825 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 414 | 382 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 | | 879 | 826 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 810 | 764 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 733 | 704 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 624 | 581 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 885 | 827 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 253 | 237 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 5.477 | 5.143 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 747 | 551 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 466 | 432 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.02.2037 | | 9.353 | 8.910 | 0,01 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.03.2035 | | 2.712 | 2.421 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 2,954 % fällig am 25.11.2035 ^ | $ | 177 | $ | 125 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.08.2034 | | 1.550 | | 1.613 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 | | 3.802 | | 3.184 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 | | 3.105 | | 3.162 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 2.098 | | 1.926 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | | 5.442 | | 3.871 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 3.850 | | 3.093 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 | | 1.072 | | 753 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 8.105 | | 4.670 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 10.385 | | 5.304 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 1.671 | | 1.483 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 1.193 | | 779 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 | | 2.981 | | 2.453 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2046 | | 1.885 | | 1.363 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2046 ^ | | 1.097 | | 793 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 | | 2.068 | | 1.852 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 668 | | 685 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 2.211 | | 1.343 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2036 | | 1.112 | | 564 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 12.545 | | 6.153 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.06.2037 | | 6.906 | | 3.092 | 0,00 |
| 6,609 % fällig am 25.02.2037 | | 13.151 | | 6.754 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | | |
| 4,108 % fällig am 25.06.2035 | | 438 | | 369 | 0,00 |
| 4,220 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 77 | | 58 | 0,00 |
| 4,267 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 167 | | 111 | 0,00 |
| 4,649 % fällig am 25.06.2035 | | 616 | | 624 | 0,00 |
| 4,765 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 106 | | 98 | 0,00 |
| 4,821 % fällig am 25.04.2037 | | 179 | | 120 | 0,00 |
| 4,903 % fällig am 25.04.2037 | | 225 | | 218 | 0,00 |
| 4,903 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 881 | | 853 | 0,00 |
| 4,905 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 703 | | 668 | 0,00 |
| 5,106 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 2.282 | | 1.888 | 0,00 |
| 5,217 % fällig am 27.07.2037 ^ | | 772 | | 693 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2036 | | 400 | | 315 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 657 | | 650 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 575 | | 577 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.09.2036 | | 1.773 | | 1.706 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 | | 2.221 | | 2.149 | 0,00 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 1,582 % fällig am 20.03.2050 | £ | 34.768 | | 44.191 | 0,06 |
| 1,732 % fällig am 20.12.2046 | | 39.590 | | 50.448 | 0,07 |
| 1,982 % fällig am 20.09.2065 | | 14.252 | | 18.236 | 0,03 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | | |
| 3,280 % fällig am 16.12.2059 | $ | 15.912 | | 15.925 | 0,02 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | £ | 245.576 | | 312.174 | 0,43 |
| 2,004 % fällig am 20.08.2056 | | 100.000 | | 126.765 | 0,17 |
| **RMAC Securities PLC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.06.2044 | € | 2.946 | | 3.214 | 0,01 |
| 0,943 % fällig am 12.06.2044 | £ | 2.630 | | 3.185 | 0,01 |
| 0,963 % fällig am 12.06.2044 | | 1.040 | | 1.256 | 0,00 |
| 2,586 % fällig am 12.06.2044 | $ | 459 | | 434 | 0,00 |
| **Rochester Financing PLC** | | | | | |
| 2,081 % fällig am 18.06.2045 | £ | 22.880 | | 29.277 | 0,04 |
| **Roundstone Securities DAC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 28.09.2055 | € | 19.776 | | 10.083 | 0,01 |
| 0,257 % fällig am 28.09.2055 | | 203.857 | | 229.779 | 0,31 |
| 0,407 % fällig am 28.09.2055 | | 15.538 | | 16.383 | 0,02 |
| 0,657 % fällig am 28.09.2055 | | 10.594 | | 10.786 | 0,02 |
| 1,000 % fällig am 28.09.2055 | | 3.941 | | 1.406 | 0,00 |
| 1,157 % fällig am 28.09.2055 | | 6.356 | | 6.491 | 0,01 |
| 1,907 % fällig am 28.09.2055 | | 10.594 | | 10.090 | 0,01 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | | |
| 3,023 % fällig am 20.11.2034 | $ | 1.519 | | 1.526 | 0,00 |
| 3,453 % fällig am 20.02.2034 | | 649 | | 635 | 0,00 |
| 4,044 % fällig am 20.07.2037 | | 3.636 | | 3.443 | 0,01 |
| 4,412 % fällig am 20.06.2037 | | 8.786 | | 8.502 | 0,01 |
| **Sestante Finance SRL** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 23.07.2046 | € | 24.482 | | 25.250 | 0,04 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | | |
| 1,457 % fällig am 21.01.2070 | £ | 100.000 | | 127.548 | 0,18 |
| 3,148 % fällig am 21.01.2070 | $ | 24.500 | | 24.517 | 0,03 |
| **Slate PLC** | | | | | |
| 2,272 % fällig am 24.01.2051 | £ | 59.800 | | 76.320 | 0,11 |
| 2,672 % fällig am 24.01.2051 | | 26.923 | | 34.372 | 0,05 |
| **Southern Pacific Financing PLC** | | | | | |
| 0,966 % fällig am 10.06.2043 | | 135 | | 170 | 0,00 |
| **Stanlington PLC** | | | | | |
| 1,793 % fällig am 12.06.2046 | | 10.149 | | 12.925 | 0,02 |
| **Stonemont Portfolio Trust** | | | | | |
| 3,233 % fällig am 20.08.2030 | $ | 54.017 | $ | 54.057 | 0,07 |
| 3,483 % fällig am 20.08.2030 | | 23.469 | | 23.494 | 0,03 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 0,490 % fällig am 25.09.2034 | | 533 | | 509 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | | 1.606 | | 1.530 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 942 | | 872 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.10.2035 | | 4.317 | | 4.066 | 0,01 |
| 2,954 % fällig am 25.09.2034 | | 6.365 | | 6.221 | 0,01 |
| 3,054 % fällig am 25.08.2035 | | 3.705 | | 3.285 | 0,01 |
| 3,904 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 53 | | 53 | 0,00 |
| 4,033 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 177 | | 177 | 0,00 |
| 4,044 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 590 | | 539 | 0,00 |
| 4,065 % fällig am 25.10.2036 | | 4.940 | | 4.849 | 0,01 |
| 4,176 % fällig am 25.01.2035 | | 548 | | 547 | 0,00 |
| 4,195 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 5.331 | | 4.988 | 0,01 |
| 4,243 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 289 | | 234 | 0,00 |
| 4,246 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 1.460 | | 1.381 | 0,00 |
| 4,270 % fällig am 25.11.2035 | | 85 | | 75 | 0,00 |
| 4,364 % fällig am 25.01.2035 | | 153 | | 152 | 0,00 |
| 4,425 % fällig am 25.08.2036 | | 6.450 | | 5.642 | 0,01 |
| 4,451 % fällig am 25.02.2035 | | 6.853 | | 6.985 | 0,01 |
| 4,472 % fällig am 25.08.2034 | | 318 | | 323 | 0,00 |
| 4,475 % fällig am 25.12.2034 | | 18 | | 18 | 0,00 |
| 4,485 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 464 | | 411 | 0,00 |
| 4,561 % fällig am 25.09.2034 | | 11 | | 11 | 0,00 |
| 4,642 % fällig am 25.04.2036 | | 841 | | 869 | 0,00 |
| 4,676 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 249 | | 231 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.08.2036 | | 23.750 | | 22.200 | 0,03 |
| 2,524 % fällig am 25.10.2036 | | 11.602 | | 10.668 | 0,02 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | | 8.585 | | 8.229 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.02.2036 | | 5.432 | | 5.076 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.01.2037 | | 1.724 | | 1.658 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.07.2046 | | 7.681 | | 7.215 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.09.2047 | | 448 | | 433 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.02.2036 | | 621 | | 555 | 0,00 |
| 2,614 % fällig am 25.05.2036 | | 6.395 | | 6.034 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 24.168 | | 24.773 | 0,03 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2036 | | 20.184 | | 19.061 | 0,03 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2047 | | 21.492 | | 20.861 | 0,03 |
| 2,640 % fällig am 19.07.2035 | | 86 | | 85 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 211 | | 203 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.05.2045 | | 124 | | 124 | 0,00 |
| 2,870 % fällig am 19.04.2035 | | 7 | | 7 | 0,00 |
| 2,954 % fällig am 25.09.2047 ^ | | 10.644 | | 9.276 | 0,01 |
| 3,468 % fällig am 25.05.2047 ^ | | 5.115 | | 4.650 | 0,01 |
| 3,515 % fällig am 19.12.2033 | | 1.135 | | 942 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 2.862 | | 2.944 | 0,00 |
| 3,965 % fällig am 19.10.2034 | | 815 | | 804 | 0,00 |
| 4,070 % fällig am 27.12.2035 ^ | | 280 | | 309 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.07.2035 | | 2.915 | | 2.750 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.05.2036 | | 3.155 | | 2.793 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.02.2035 | | 447 | | 437 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 19 | | 19 | 0,00 |
| **SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,316 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 1.856 | | 1.778 | 0,00 |
| 4,423 % fällig am 25.06.2037 | | 5.402 | | 5.352 | 0,01 |
| **Sutherland Commercial Mortgage Loans** | | | | | |
| 3,192 % fällig am 25.05.2037 | | 5.634 | | 5.595 | 0,01 |
| **Taurus DEU DAC** | | | | | |
| 1,300 % fällig am 17.11.2026 | € | 2.152 | | 2.456 | 0,00 |
| **Taurus UK DAC** | | | | | |
| 1,654 % fällig am 17.11.2027 | £ | 34.533 | | 43.787 | 0,06 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.07.2036 ^ | $ | 18 | | 11 | 0,00 |
| 5,965 % fällig am 25.07.2037 | | 5.166 | | 2.788 | 0,00 |
| **TDA Mixto Fondo de Titulizacion de Activos** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 22.06.2040 | € | 10.466 | | 10.261 | 0,01 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,684 % fällig am 25.10.2037 | $ | 6.960 | | 2.352 | 0,00 |
| **Tharaldson Hotel Portfolio Trust** | | | | | |
| 3,519 % fällig am 11.11.2034 | | 27.138 | | 27.152 | 0,04 |
| 3,769 % fällig am 11.11.2034 | | 13.609 | | 13.625 | 0,02 |
| 4,419 % fällig am 11.11.2034 | | 22.601 | | 22.646 | 0,03 |
| **Theatre Hospitals PLC** | | | | | |
| 3,821 % fällig am 15.10.2031 | £ | 14.534 | | 17.261 | 0,02 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 3,452 % fällig am 25.06.2037 | $ | 185 | $ | 175 | 0,00 |
| 4,104 % fällig am 25.09.2037 | | 3.423 | | 3.503 | 0,01 |
| 4,131 % fällig am 25.09.2037 | | 2.259 | | 2.281 | 0,00 |
| 4,557 % fällig am 25.04.2036 | | 3.037 | | 2.962 | 0,00 |
| 4,649 % fällig am 25.10.2046 | | 162 | | 165 | 0,00 |
| 4,842 % fällig am 25.07.2036 | | 4.158 | | 4.070 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.02.2045 | £ | 24.767 | | 31.340 | 0,04 |
| 1,654 % fällig am 20.05.2045 | | 60.770 | | 77.419 | 0,11 |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 5.000 | | 6.388 | 0,01 |
| 2,004 % fällig am 20.02.2054 | | 51.772 | | 66.034 | 0,09 |
| **Trinidad Mortgage Securities PLC** | | | | | |
| 1,622 % fällig am 24.01.2059 | | 22.584 | | 28.550 | 0,04 |
| **Trinity Square PLC** | | | | | |
| 1,971 % fällig am 15.07.2051 | | 3.986 | | 5.102 | 0,01 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | | |
| 1,573 % fällig am 12.09.2044 | | 23.297 | | 29.546 | 0,04 |
| 1,668 % fällig am 12.09.2050 | | 30.365 | | 38.569 | 0,05 |
| 1,781 % fällig am 12.12.2052 | | 30.000 | | 38.143 | 0,05 |
| **UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust** | | | | | |
| 1,093 % fällig am 10.03.2046 (a) | $ | 111.884 | | 3.208 | 0,01 |
| 1,269 % fällig am 10.04.2046 (a) | | 9.767 | | 344 | 0,00 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | | |
| 0,986 % fällig am 10.06.2059 | £ | 12.353 | | 15.040 | 0,02 |
| 1,136 % fällig am 10.06.2059 | | 4.286 | | 5.133 | 0,01 |
| 1,174 % fällig am 10.10.2040 | | 10.443 | | 12.266 | 0,02 |
| 1,336 % fällig am 10.06.2059 | | 3.352 | | 4.015 | 0,01 |
| 1,536 % fällig am 10.06.2059 | | 3.572 | | 4.263 | 0,01 |
| **VMC Finance LLC** | | | | | |
| 3,214 % fällig am 15.03.2035 | $ | 9.143 | | 9.166 | 0,01 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust LLC** | | | | | |
| 4,604 % fällig am 20.10.2035 ^ | | 713 | | 723 | 0,00 |
| 4,626 % fällig am 20.08.2035 ^ | | 1.763 | | 1.627 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | | |
| 2,345 % fällig am 25.01.2047 | | 4.566 | | 4.551 | 0,01 |
| 2,345 % fällig am 25.07.2047 ^ | | 2.838 | | 2.379 | 0,00 |
| 2,458 % fällig am 25.05.2046 | | 72 | | 69 | 0,00 |
| 2,595 % fällig am 25.09.2046 | | 4.215 | | 4.319 | 0,01 |
| 2,595 % fällig am 25.10.2046 | | 4.276 | | 4.128 | 0,01 |
| 2,595 % fällig am 25.11.2046 | | 3.214 | | 3.231 | 0,01 |
| 2,714 % fällig am 25.01.2045 | | 2.328 | | 2.319 | 0,00 |
| 2,894 % fällig am 25.10.2045 | | 10.306 | | 10.419 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.12.2045 | | 15.069 | | 15.458 | 0,02 |
| 2,914 % fällig am 25.08.2045 | | 11.408 | | 11.531 | 0,02 |
| 3,004 % fällig am 25.10.2045 | | 18.514 | | 17.166 | 0,02 |
| 3,204 % fällig am 25.02.2047 ^ | | 4.671 | | 4.510 | 0,01 |
| 3,204 % fällig am 25.03.2047 ^ | | 1.102 | | 1.013 | 0,00 |
| 3,254 % fällig am 25.06.2047 | | 21.022 | | 20.188 | 0,03 |
| 3,264 % fällig am 25.04.2047 | | 491 | | 493 | 0,00 |
| 3,274 % fällig am 25.04.2047 ^ | | 3.811 | | 3.531 | 0,01 |
| 3,274 % fällig am 25.05.2047 | | 220 | | 210 | 0,00 |
| 3,279 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 1.841 | | 1.742 | 0,00 |
| 3,292 % fällig am 25.12.2046 | | 4.443 | | 4.468 | 0,01 |
| 3,302 % fällig am 25.12.2046 ^ | | 11.887 | | 11.040 | 0,02 |
| 3,314 % fällig am 25.07.2047 | | 21.314 | | 19.552 | 0,03 |
| 3,318 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 6.095 | | 5.648 | 0,01 |
| 3,384 % fällig am 25.10.2046 ^ | | 11.712 | | 11.067 | 0,02 |
| 3,424 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 6.974 | | 6.684 | 0,01 |
| 3,504 % fällig am 25.02.2046 | | 5.474 | | 5.598 | 0,01 |
| 3,561 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 1.730 | | 1.636 | 0,00 |
| 3,612 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 6.317 | | 6.077 | 0,01 |
| 3,670 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 3.150 | | 2.826 | 0,00 |
| 3,680 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 278 | | 252 | 0,00 |
| 3,683 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 12.061 | | 11.478 | 0,02 |
| 3,696 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 2.518 | | 2.373 | 0,00 |
| 3,700 % fällig am 25.12.2036 | | 1.064 | | 1.025 | 0,00 |
| 3,700 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 437 | | 421 | 0,00 |
| 3,730 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 1.832 | | 1.744 | 0,00 |
| 3,742 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 3.017 | | 2.884 | 0,00 |
| 3,807 % fällig am 25.05.2037 | | 3.223 | | 2.946 | 0,00 |
| 3,815 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 2.067 | | 1.997 | 0,00 |
| 3,819 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 8.960 | | 8.381 | 0,01 |
| 3,833 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 1.427 | | 1.348 | 0,00 |
| 3,851 % fällig am 25.08.2046 ^ | | 357 | | 349 | 0,00 |
| 3,897 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 3.234 | | 3.024 | 0,00 |
| 3,910 % fällig am 25.08.2046 ^ | | 1.840 | | 1.780 | 0,00 |
| 3,915 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 5.435 | | 5.336 | 0,01 |
| 3,957 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 22.601 | | 22.541 | 0,03 |
| 3,961 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 8.258 | | 8.151 | 0,01 |
| 3,998 % fällig am 25.09.2036 | | 8.214 | | 7.990 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,998 % fällig am 25.07.2037 ^ | $ | 7.687 | $ 7.277 | 0,01 |
| 4,077 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 3.279 | 3.237 | 0,01 |
| 4,181 % fällig am 25.12.2035 | | 12.631 | 12.602 | 0,02 |
| 4,266 % fällig am 25.04.2035 | | 3.769 | 3.903 | 0,01 |
| 4,270 % fällig am 25.03.2037 | | 68 | 68 | 0,00 |
| 4,394 % fällig am 25.01.2035 | | 4.260 | 4.423 | 0,01 |
| 4,538 % fällig am 25.07.2034 | | 607 | 455 | 0,00 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.12.2049 (f) | £ | 2 | 9.004 | 0,01 |
| 1,584 % fällig am 21.12.2049 | | 119.397 | 150.961 | 0,21 |
| 1,775 % fällig am 21.09.2049 | | 89.931 | 114.790 | 0,16 |
| 2,275 % fällig am 21.09.2049 | | 51.842 | 66.469 | 0,09 |
| 2,284 % fällig am 21.12.2049 | | 12.810 | 16.552 | 0,02 |
| 2,784 % fällig am 21.12.2049 | | 6.405 | 8.152 | 0,01 |
| 3,284 % fällig am 21.12.2049 | | 3.660 | 4.674 | 0,01 |
| 3,784 % fällig am 21.12.2049 | | 3.660 | 4.584 | 0,01 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.02.2037 ^ | $ | 1.488 | 1.199 | 0,00 |
| 2,754 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 2.679 | 2.182 | 0,00 |
| 2,854 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 6.083 | 5.129 | 0,01 |
| 3,264 % fällig am 25.04.2047 ^ | | 7.715 | 7.234 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.11.2046 | | 176 | 164 | 0,00 |
| 3,424 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 6.039 | 5.277 | 0,01 |
| 3,444 % fällig am 25.07.2046 ^ | | 8.819 | 6.543 | 0,01 |
| 3,464 % fällig am 25.08.2046 | | 6.087 | 4.569 | 0,01 |
| 4,313 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 760 | 393 | 0,00 |
| 4,455 % fällig am 25.01.2035 | | 445 | 453 | 0,00 |
| 4,458 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 12.455 | 7.324 | 0,01 |
| 4,657 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 4.827 | 2.338 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 ^ | | 2.194 | 2.148 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 157 | 156 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 657 | 615 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 265 | 252 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 5.971 | 6.214 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2036 | | 8.470 | 7.845 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | | 5.603 | 5.603 | 0,01 |
| 6,312 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 13.282 | 5.745 | 0,01 |
| 6,449 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 2.415 | 1.044 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 8.371 | 6.689 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 5.385 | 4.510 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 5.831 | 5.321 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 25.02.2036 | | 4.321 | 3.634 | 0,01 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 2.622 | 1.880 | 0,00 |
| 2,834 % fällig am 25.06.2037 | | 2.306 | 1.901 | 0,00 |
| 3,666 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 2.402 | 298 | 0,00 |
| **Wells Fargo Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 2,800 % fällig am 18.03.2028 | | 27.900 | 27.900 | 0,04 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.09.2036 ^(b)(f) | | 1 | 0 | 0,00 |
| 3,204 % fällig am 25.01.2036 | | 643 | 635 | 0,00 |
| 4,698 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 2.850 | 2.798 | 0,00 |
| 4,711 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 3.173 | 3.120 | 0,01 |
| 4,716 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 5.162 | 5.270 | 0,01 |
| 4,742 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 235 | 223 | 0,00 |
| 4,760 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 103 | 104 | 0,00 |
| 4,803 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 844 | 826 | 0,00 |
| 4,843 % fällig am 25.06.2035 | | 194 | 199 | 0,00 |
| 4,859 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 751 | 757 | 0,00 |
| 4,869 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 2.397 | 2.386 | 0,00 |
| 4,872 % fällig am 25.04.2037 | | 1.510 | 1.490 | 0,00 |
| 4,930 % fällig am 25.10.2035 | | 400 | 413 | 0,00 |
| 4,971 % fällig am 25.12.2034 | | 5.309 | 5.485 | 0,01 |
| 4,988 % fällig am 25.06.2035 | | 3.345 | 3.482 | 0,01 |
| 4,990 % fällig am 26.06.2035 | | 10 | 10 | 0,00 |
| 4,991 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 702 | 704 | 0,00 |
| 4,992 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 2.192 | 2.232 | 0,00 |
| 4,994 % fällig am 25.03.2035 | | 16 | 17 | 0,00 |
| 5,101 % fällig am 25.05.2036 | | 6.706 | 6.928 | 0,01 |
| 5,159 % fällig am 25.03.2036 | | 3.862 | 3.849 | 0,01 |
| 5,165 % fällig am 25.04.2035 | | 4.949 | 5.121 | 0,01 |
| 5,178 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 1.499 | 1.524 | 0,00 |
| 5,222 % fällig am 25.04.2036 | | 40 | 40 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.04.2036 | | 366 | 122 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 2.053 | 2.026 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 2.064 | 2.022 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 2.462 | 2.499 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.06.2037 ^ | | 2.665 | 2.740 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 9 | 9 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2037 ^ | | 1.353 | 1.370 | 0,00 |
| **Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 0,590 % fällig am 15.03.2047 (a) | $ | 83.200 | $ 1.730 | 0,00 |
| 0,630 % fällig am 15.03.2047 (a) | | 90.193 | 2.251 | 0,00 |
| 1,346 % fällig am 15.03.2045 (a) | | 91.409 | 3.320 | 0,01 |
| | | | 10.421.053 | 14,23 |

**FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Aames Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 3,184 % fällig am 25.10.2035 | | 13.500 | 13.490 | 0,02 |
| **AccessLex Institute** | | | | |
| 2,559 % fällig am 26.09.2033 | | 21.052 | 20.602 | 0,03 |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,534 % fällig am 25.02.2037 | | 368 | 369 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.02.2037 | | 1.000 | 949 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.09.2036 | | 21.873 | 21.518 | 0,03 |
| 2,674 % fällig am 25.02.2037 | | 9.754 | 7.604 | 0,01 |
| 2,724 % fällig am 25.12.2035 | | 744 | 744 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 18.735 | 11.130 | 0,02 |
| 2,945 % fällig am 25.09.2035 | | 5.921 | 5.460 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 25.07.2035 | | 4.702 | 4.722 | 0,01 |
| 3,424 % fällig am 25.07.2035 | | 2.496 | 2.437 | 0,00 |
| 3,439 % fällig am 25.04.2035 | | 1.374 | 1.392 | 0,00 |
| 3,484 % fällig am 25.10.2034 | | 2.157 | 2.177 | 0,00 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 9.569 | 3.103 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.12.2036 | | 14.550 | 9.234 | 0,01 |
| 2,534 % fällig am 25.12.2036 | | 34.940 | 22.612 | 0,03 |
| 2,544 % fällig am 25.07.2036 | | 9.352 | 9.024 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 34.091 | 16.490 | 0,02 |
| 2,559 % fällig am 25.08.2036 | | 11.616 | 11.387 | 0,02 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | | 4.021 | 2.975 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.12.2036 | | 253 | 128 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.04.2036 | | 8.823 | 8.482 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.07.2036 | | 8.419 | 4.140 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.06.2037 | | 4.805 | 4.744 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.02.2036 | | 3.519 | 3.516 | 0,01 |
| 3,019 % fällig am 25.12.2035 | | 4.200 | 4.016 | 0,01 |
| 3,064 % fällig am 25.11.2035 | | 8.348 | 8.403 | 0,01 |
| 3,094 % fällig am 25.05.2035 | | 2.422 | 2.442 | 0,00 |
| 3,169 % fällig am 25.08.2035 | | 566 | 567 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.12.2034 | | 4.910 | 4.872 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.08.2035 | | 1.800 | 1.791 | 0,00 |
| 4,204 % fällig am 25.06.2034 | | 998 | 971 | 0,00 |
| **Adams Mill CLO Ltd.** | | | | |
| 3,697 % fällig am 15.07.2026 | | 12.022 | 12.029 | 0,02 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | | 849 | 678 | 0,00 |
| 2,844 % fällig am 25.06.2035 | | 5.290 | 5.248 | 0,01 |
| 2,884 % fällig am 25.08.2035 | | 622 | 622 | 0,00 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 4,129 % fällig am 25.10.2034 | | 1.719 | 1.762 | 0,00 |
| **ALESCO Preferred Funding Ltd.** | | | | |
| 2,623 % fällig am 23.12.2037 | | 38.008 | 35.918 | 0,05 |
| 2,663 % fällig am 23.09.2037 | | 8.492 | 7.686 | 0,01 |
| 2,703 % fällig am 23.06.2036 | | 32.683 | 30.232 | 0,04 |
| 2,723 % fällig am 23.12.2035 | | 29.959 | 27.862 | 0,04 |
| 2,743 % fällig am 23.09.2037 | | 2.000 | 1.620 | 0,00 |
| 2,793 % fällig am 23.12.2036 | | 5.000 | 4.100 | 0,01 |
| 2,863 % fällig am 23.07.2035 | | 15.152 | 13.637 | 0,02 |
| 3,093 % fällig am 23.09.2038 | | 9.759 | 9.198 | 0,01 |
| **ALME Loan Funding DAC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.01.2030 | € | 29.600 | 33.934 | 0,05 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,504 % fällig am 25.10.2036 | $ | 26.611 | 11.927 | 0,02 |
| 2,579 % fällig am 25.10.2036 | | 16.314 | 11.443 | 0,02 |
| 2,744 % fällig am 25.04.2036 | | 4.800 | 4.767 | 0,01 |
| 2,774 % fällig am 25.04.2036 | | 6.319 | 6.159 | 0,01 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.01.2036 | | 24.220 | 24.182 | 0,03 |
| 2,874 % fällig am 25.01.2036 | | 9.008 | 8.985 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.01.2036 | | 4.850 | 4.818 | 0,01 |
| 2,984 % fällig am 25.11.2035 | | 14.162 | 13.069 | 0,02 |
| 3,054 % fällig am 25.09.2035 | | 5.750 | 5.328 | 0,01 |
| 3,144 % fällig am 25.12.2033 | | 456 | 456 | 0,00 |
| 3,169 % fällig am 25.05.2035 | | 11.714 | 11.761 | 0,02 |
| 3,169 % fällig am 25.10.2035 | | 2.408 | 2.416 | 0,00 |
| 3,199 % fällig am 25.03.2035 | | 7.754 | 7.808 | 0,01 |
| 3,364 % fällig am 25.10.2035 | | 8.996 | 8.483 | 0,01 |
| 3,379 % fällig am 25.07.2035 | $ | 21.391 | $ 20.808 | 0,03 |
| 3,424 % fällig am 25.01.2035 ^ | | 4.863 | 4.728 | 0,01 |
| 3,454 % fällig am 25.04.2035 | | 6.000 | 5.972 | 0,01 |
| 3,499 % fällig am 25.09.2034 | | 8.765 | 8.610 | 0,01 |
| 3,554 % fällig am 25.08.2035 | | 2.000 | 1.796 | 0,00 |
| 3,793 % fällig am 25.06.2033 ^ | | 2.765 | 2.681 | 0,00 |
| 3,964 % fällig am 25.01.2035 | | 1.907 | 1.818 | 0,00 |
| 4,054 % fällig am 25.02.2034 | | 587 | 571 | 0,00 |
| 4,054 % fällig am 25.11.2034 | | 1.399 | 1.402 | 0,00 |
| 4,279 % fällig am 25.07.2034 | | 3.086 | 3.170 | 0,00 |
| 4,354 % fällig am 25.06.2034 | | 3.320 | 3.136 | 0,00 |
| 5,254 % fällig am 25.07.2034 | | 2.893 | 2.913 | 0,00 |
| **Amortizing Residential Collateral Trust** | | | | |
| 3,529 % fällig am 25.08.2032 | | 272 | 264 | 0,00 |
| **Arbor Realty Collateralized Loan Obligation Ltd.** | | | | |
| 3,384 % fällig am 15.12.2027 | | 26.000 | 26.037 | 0,04 |
| **Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.** | | | | |
| 3,384 % fällig am 15.08.2027 | | 28.087 | 28.133 | 0,04 |
| 3,694 % fällig am 15.04.2027 | | 21.100 | 21.154 | 0,03 |
| **Arbour CLO DAC** | | | | |
| 0,870 % fällig am 15.01.2030 | € | 13.000 | 14.802 | 0,02 |
| **Argent Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.05.2035 | $ | 13.985 | 13.507 | 0,02 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.05.2036 | | 4.688 | 1.748 | 0,00 |
| 2,514 % fällig am 25.09.2036 | | 17.881 | 7.287 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 45.714 | 39.866 | 0,05 |
| 2,564 % fällig am 25.05.2036 | | 13.439 | 5.077 | 0,01 |
| 2,579 % fällig am 25.04.2036 | | 2.037 | 1.297 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.03.2036 | | 25.621 | 21.864 | 0,03 |
| 2,644 % fällig am 25.09.2036 | | 14.013 | 5.829 | 0,01 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.10.2035 | | 5.212 | 5.236 | 0,01 |
| 2,784 % fällig am 25.02.2036 | | 14.043 | 11.493 | 0,02 |
| 2,844 % fällig am 25.11.2035 | | 18.658 | 18.554 | 0,03 |
| 2,914 % fällig am 25.10.2035 | | 5.750 | 5.543 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.05.2034 | | 313 | 309 | 0,00 |
| 3,529 % fällig am 25.11.2034 | | 3.569 | 3.602 | 0,01 |
| 4,279 % fällig am 25.04.2034 | | 966 | 990 | 0,00 |
| 4,427 % fällig am 25.02.2034 | | 654 | 654 | 0,00 |
| **Aspen Funding Ltd.** | | | | |
| 4,184 % fällig am 10.07.2037 | | 551 | 549 | 0,00 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.10.2036 | | 429 | 414 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.11.2036 | | 12.351 | 8.292 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | | 16.114 | 10.593 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2036 | | 15.003 | 11.501 | 0,02 |
| 2,644 % fällig am 25.09.2036 | | 1.175 | 1.110 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 9.498 | 5.376 | 0,01 |
| 2,944 % fällig am 25.11.2034 | | 2.414 | 2.421 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.03.2035 | | 7.284 | 7.356 | 0,01 |
| 3,104 % fällig am 25.06.2034 | | 4.876 | 4.864 | 0,01 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.12.2036 | | 1.153 | 1.134 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.05.2036 | | 8.312 | 8.287 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.03.2036 | | 3.381 | 3.378 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.12.2036 | | 9.045 | 8.052 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.03.2036 | | 2.655 | 2.341 | 0,00 |
| 2,694 % fällig am 25.03.2036 | | 3.145 | 2.735 | 0,00 |
| 2,854 % fällig am 25.11.2035 | | 8.496 | 8.545 | 0,01 |
| 3,004 % fällig am 25.11.2035 | | 3.597 | 3.595 | 0,01 |
| 3,379 % fällig am 25.05.2035 | | 5.000 | 5.066 | 0,01 |
| 3,379 % fällig am 25.06.2035 ^ | | 4.510 | 4.059 | 0,01 |
| 3,424 % fällig am 25.07.2035 | | 3.500 | 3.453 | 0,01 |
| 4,204 % fällig am 25.09.2034 | | 799 | 698 | 0,00 |
| 4,249 % fällig am 25.05.2035 | | 307 | 316 | 0,00 |
| 4,579 % fällig am 25.09.2034 | | 2.461 | 2.412 | 0,00 |
| **Atlas Senior Loan Fund Ltd.** | | | | |
| 3,631 % fällig am 20.04.2028 | | 17.685 | 17.607 | 0,02 |
| **Avery Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,680 % fällig am 25.04.2026 | | 7.773 | 7.777 | 0,01 |
| **B&M CLO Ltd.** | | | | |
| 3,331 % fällig am 16.04.2026 | | 33.403 | 33.369 | 0,05 |
| **Basic Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,714 % fällig am 25.04.2036 | | 1.194 | 1.197 | 0,00 |
| **Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,272 % fällig am 28.04.2036 | | 3.053 | 2.891 | 0,00 |
| **Bayview Opportunity Master Fund Trust** | | | | |
| 4,066 % fällig am 28.09.2033 | | 1.880 | 1.900 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.02.2037 | $ | 6.179 | $ | 6.794 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.11.2036 | | 1.440 | | 1.411 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.05.2035 | | 123 | | 132 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.08.2036 | | 6.820 | | 6.417 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.04.2037 ^ | | 4.286 | | 4.579 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.05.2037 | | 5.402 | | 5.146 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 5.749 | | 4.673 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.06.2036 | | 3.815 | | 3.815 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.06.2047 | | 1.241 | | 1.161 | 0,00 |
| 2,744 % fällig am 25.12.2036 | | 17.235 | | 16.614 | 0,02 |
| 2,754 % fällig am 25.06.2047 | | 13.885 | | 12.050 | 0,02 |
| 2,764 % fällig am 25.04.2036 | | 5.639 | | 5.617 | 0,01 |
| 2,804 % fällig am 25.02.2036 | | 5.718 | | 5.704 | 0,01 |
| 2,824 % fällig am 25.12.2035 | | 4.039 | | 4.056 | 0,01 |
| 2,854 % fällig am 25.01.2047 | | 5.261 | | 5.136 | 0,01 |
| 2,894 % fällig am 25.09.2035 | | 295 | | 295 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.12.2035 | | 3.170 | | 3.177 | 0,00 |
| 3,075 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 1.105 | | 1.107 | 0,00 |
| 3,079 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 4.399 | | 4.410 | 0,01 |
| 3,104 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 3.392 | | 3.167 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.12.2035 | | 2.389 | | 1.883 | 0,00 |
| 3,204 % fällig am 25.06.2036 | | 3.191 | | 3.089 | 0,00 |
| 3,379 % fällig am 25.08.2035 | | 1.914 | | 1.921 | 0,00 |
| 3,404 % fällig am 25.10.2037 | | 4.722 | | 4.756 | 0,01 |
| 3,409 % fällig am 25.06.2035 | | 5.922 | | 5.938 | 0,01 |
| 3,454 % fällig am 25.08.2037 | | 17.036 | | 15.055 | 0,02 |
| 3,529 % fällig am 25.02.2035 | | 994 | | 1.003 | 0,00 |
| 3,799 % fällig am 25.01.2035 | | 1.066 | | 1.077 | 0,00 |
| 4,159 % fällig am 25.09.2034 | | 1.679 | | 1.691 | 0,00 |
| 4,354 % fällig am 25.11.2039 | | 3.196 | | 3.276 | 0,00 |
| 4,504 % fällig am 25.09.2034 | | 402 | | 402 | 0,00 |
| 4,579 % fällig am 25.01.2035 | | 2.399 | | 2.415 | 0,00 |
| 4,654 % fällig am 25.08.2034 | | 807 | | 777 | 0,00 |
| 4,862 % fällig am 25.10.2036 | | 285 | | 282 | 0,00 |
| 5,404 % fällig am 25.02.2034 | | 258 | | 265 | 0,00 |
| 5,554 % fällig am 25.12.2042 | | 2.526 | | 2.627 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 2.325 | | 1.778 | 0,00 |
| **Bear Stearns Structured Products Trust** | | | | | |
| 4,404 % fällig am 25.03.2037 | | 3.251 | | 3.083 | 0,00 |
| **Benefit Street Partners CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,381 % fällig am 18.07.2027 | | 3.900 | | 3.874 | 0,01 |
| **BFNS LLC** | | | | | |
| 3,994 % fällig am 25.01.2029 | | 10.975 | | 10.972 | 0,02 |
| **Black Diamond CLO Designated Activity Co.** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € | 19.500 | | 22.231 | 0,03 |
| 3,646 % fällig am 03.10.2029 | $ | 20.168 | | 20.222 | 0,03 |
| **Black Diamond CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,638 % fällig am 06.02.2026 | | 15.823 | | 15.828 | 0,02 |
| **BNC Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.03.2037 | | 17.115 | | 16.477 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.07.2037 | | 14.750 | | 13.363 | 0,02 |
| 2,714 % fällig am 25.05.2037 | | 10.174 | | 9.725 | 0,01 |
| **BNP Paribas Issuance BV** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 12.04.2024 | | 12 | | 2.156.120 | 2,94 |
| **Bombardier Capital Mortgage Securitization Corp.** | | | | | |
| 7,180 % fällig am 15.12.2029 | | 980 | | 323 | 0,00 |
| 7,440 % fällig am 15.12.2029 | | 10.140 | | 3.464 | 0,01 |
| 7,575 % fällig am 15.06.2030 | | 936 | | 329 | 0,00 |
| **Brookside Mill CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,408 % fällig am 17.01.2028 | | 19.310 | | 19.217 | 0,03 |
| **BSPRT Issuer Ltd.** | | | | | |
| 3,330 % fällig am 15.03.2028 | | 23.910 | | 23.942 | 0,03 |
| **Business Jet Securities LLC** | | | | | |
| 4,335 % fällig am 15.02.2033 | | 15.010 | | 15.182 | 0,02 |
| 4,447 % fällig am 15.06.2033 | | 10.215 | | 10.373 | 0,01 |
| **Camber PLC** | | | | | |
| 2,762 % fällig am 09.11.2053 | | 30.714 | | 1.492 | 0,00 |
| **Capitalsource Real Estate Loan Trust** | | | | | |
| 2,974 % fällig am 20.01.2037 | | 6.541 | | 6.394 | 0,01 |
| 3,242 % fällig am 20.01.2037 | | 15.000 | | 13.887 | 0,02 |
| 3,342 % fällig am 20.01.2037 | | 5.400 | | 4.927 | 0,01 |
| 3,442 % fällig am 20.01.2037 | | 3.000 | | 2.137 | 0,00 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | | |
| 0,730 % fällig am 21.09.2029 | € | 4.975 | | 5.668 | 0,01 |
| 0,870 % fällig am 18.01.2030 | | 20.000 | | 22.778 | 0,03 |
| 1,200 % fällig am 21.09.2029 | | 1.300 | | 1.497 | 0,00 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | | |
| 1,200 % fällig am 16.04.2029 | | 2.400 | | 2.767 | 0,00 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.02.2037 | $ | 22.875 | $ | 21.567 | 0,03 |
| 2,864 % fällig am 25.06.2035 | | 853 | | 856 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.10.2035 | | 10.914 | | 10.799 | 0,02 |
| 2,934 % fällig am 25.09.2035 | | 5.752 | | 5.725 | 0,01 |
| 3,064 % fällig am 25.06.2035 | | 10.000 | | 9.980 | 0,01 |
| 3,379 % fällig am 25.05.2035 | | 2.990 | | 3.004 | 0,00 |
| **Castle Park CLO Designated Activity Co.** | | | | | |
| 0,690 % fällig am 15.01.2028 | € | 10.400 | | 11.874 | 0,02 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,432 % fällig am 27.01.2028 | $ | 47.000 | | 46.812 | 0,06 |
| **Cavendish Square Funding PLC** | | | | | |
| 0,292 % fällig am 11.02.2055 | € | 788 | | 893 | 0,00 |
| 0,632 % fällig am 11.02.2055 | | 3.800 | | 4.319 | 0,01 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.01.2035 | $ | 3.108 | | 3.121 | 0,00 |
| 3,364 % fällig am 25.03.2035 | | 3.157 | | 3.050 | 0,00 |
| 5,560 % fällig am 25.09.2034 | | 666 | | 690 | 0,00 |
| **Chapel BV** | | | | | |
| 0,050 % fällig am 17.07.2066 | € | 3.324 | | 3.779 | 0,01 |
| **Chase Funding Loan Acquisition Trust** | | | | | |
| 3,204 % fällig am 25.05.2034 | $ | 1.851 | | 1.868 | 0,00 |
| **Chase Funding Trust** | | | | | |
| 3,154 % fällig am 25.09.2033 | | 561 | | 557 | 0,00 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | | | |
| 3,377 % fällig am 15.04.2027 | | 46.206 | | 46.182 | 0,06 |
| 3,440 % fällig am 25.10.2027 | | 45.945 | | 45.715 | 0,06 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 3,780 % fällig am 25.10.2037 | | 32.146 | | 32.596 | 0,04 |
| 3,880 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 8.845 | | 8.903 | 0,01 |
| 3,930 % fällig am 25.10.2037 | | 86.966 | | 88.409 | 0,12 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,474 % fällig am 25.05.2037 | | 2.983 | | 2.180 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.12.2036 | | 15.880 | | 15.659 | 0,02 |
| 2,549 % fällig am 25.09.2036 | | 12.733 | | 12.384 | 0,02 |
| 2,554 % fällig am 25.12.2036 | | 1.246 | | 646 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.12.2036 | | 26.581 | | 18.093 | 0,03 |
| 2,579 % fällig am 25.05.2037 | | 941 | | 920 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.01.2037 | | 20.855 | | 15.328 | 0,02 |
| 2,604 % fällig am 25.05.2037 | | 6.489 | | 4.828 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.12.2036 | | 4.041 | | 3.926 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.08.2036 | | 962 | | 951 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.03.2036 | | 6.903 | | 6.406 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.07.2045 | | 6.370 | | 5.125 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.05.2037 | | 42.004 | | 38.140 | 0,05 |
| 2,804 % fällig am 25.03.2037 | | 12.298 | | 12.303 | 0,02 |
| 2,804 % fällig am 25.11.2046 | | 10.375 | | 10.229 | 0,01 |
| 2,854 % fällig am 25.11.2045 | | 1.936 | | 1.930 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 4.393 | | 4.287 | 0,01 |
| 5,775 % fällig am 25.10.2036 | | 1.468 | | 1.205 | 0,00 |
| 6,750 % fällig am 25.05.2036 | | 17.865 | | 13.332 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 3,379 % fällig am 25.05.2035 | | 948 | | 924 | 0,00 |
| 3,409 % fällig am 25.10.2034 | | 6.892 | | 6.557 | 0,01 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.06.2037 | | 3.613 | | 3.617 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.03.2037 | | 9.618 | | 8.902 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.08.2036 | | 4.090 | | 4.045 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.11.2036 | | 3.000 | | 2.994 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.01.2037 | | 5.028 | | 4.879 | 0,01 |
| 2,694 % fällig am 25.11.2036 | | 6.812 | | 6.631 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.10.2036 | | 12.630 | | 12.419 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.01.2037 | | 503 | | 458 | 0,00 |
| 2,734 % fällig am 25.10.2036 | | 400 | | 386 | 0,00 |
| 2,814 % fällig am 25.10.2035 | | 4.075 | | 4.091 | 0,01 |
| 2,854 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 3.982 | | 3.985 | 0,01 |
| 3,034 % fällig am 25.02.2035 | | 3.243 | | 3.238 | 0,00 |
| 3,524 % fällig am 25.07.2035 | | 5.266 | | 5.269 | 0,01 |
| **Colony American Finance Ltd.** | | | | | |
| 2,554 % fällig am 15.11.2048 | | 4.830 | | 4.831 | 0,01 |
| **Commonbond Student Loan Trust** | | | | | |
| 2,550 % fällig am 25.05.2041 | | 10.194 | | 10.198 | 0,01 |
| 3,254 % fällig am 25.05.2041 | | 433 | | 432 | 0,00 |
| **Conseco Finance Corp.** | | | | | |
| 6,280 % fällig am 01.09.2030 | | 8.913 | | 9.531 | 0,01 |
| 6,560 % fällig am 01.11.2028 | | 5.081 | | 5.360 | 0,01 |
| 6,760 % fällig am 01.03.2030 | | 1.393 | | 1.456 | 0,00 |
| 6,920 % fällig am 01.12.2030 | | 7.322 | | 8.088 | 0,01 |
| 7,060 % fällig am 01.02.2031 | | 2.973 | | 2.956 | 0,00 |
| 7,500 % fällig am 01.03.2030 | $ | 16.139 | $ | 11.225 | 0,02 |
| 7,850 % fällig am 15.11.2026 | | 693 | | 764 | 0,00 |
| 7,860 % fällig am 01.03.2030 | | 5.960 | | 4.288 | 0,01 |
| **Conseco Finance Securitizations Corp.** | | | | | |
| 4,190 % fällig am 01.09.2033 | | 4.114 | | 4.154 | 0,01 |
| 7,100 % fällig am 01.02.2033 | | 183 | | 193 | 0,00 |
| 7,770 % fällig am 01.09.2031 | | 1.744 | | 1.959 | 0,00 |
| 7,970 % fällig am 01.05.2032 | | 1.893 | | 813 | 0,00 |
| 8,060 % fällig am 01.09.2029 | | 14.502 | | 6.543 | 0,01 |
| 8,260 % fällig am 01.12.2030 | | 14.247 | | 7.982 | 0,01 |
| 8,310 % fällig am 01.05.2032 | | 20.232 | | 9.057 | 0,01 |
| **Contego CLO BV** | | | | | |
| 0,599 % fällig am 15.11.2026 | € | 7.624 | | 8.683 | 0,01 |
| **CoreVest American Finance Trust** | | | | | |
| 2,968 % fällig am 15.10.2049 | $ | 7.535 | | 7.581 | 0,01 |
| **Cork Street CLO Designated Activity Co.** | | | | | |
| 0,590 % fällig am 27.11.2028 | € | 5.300 | | 6.061 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | | |
| 2,534 % fällig am 25.12.2036 ^ | $ | 12.175 | | 11.466 | 0,02 |
| 2,534 % fällig am 25.09.2046 | | 4.981 | | 4.967 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.06.2035 | | 5.803 | | 5.317 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.05.2037 | | 11.188 | | 10.757 | 0,02 |
| 2,544 % fällig am 25.06.2037 | | 20.882 | | 19.804 | 0,03 |
| 2,544 % fällig am 25.07.2037 | | 14.391 | | 13.112 | 0,02 |
| 2,544 % fällig am 25.08.2037 | | 5.548 | | 5.478 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.05.2037 | | 609 | | 605 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.04.2047 ^ | | 14.508 | | 14.078 | 0,02 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 10.498 | | 10.450 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.11.2036 | | 223 | | 223 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.03.2037 | | 2.096 | | 1.983 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.05.2037 | | 1.797 | | 1.794 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.06.2047 | | 27.458 | | 27.372 | 0,04 |
| 2,584 % fällig am 25.11.2047 ^ | | 10.113 | | 9.099 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.11.2037 | | 19.421 | | 19.300 | 0,03 |
| 2,604 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 11.747 | | 10.488 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | | 12.438 | | 11.928 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.08.2037 | | 20.000 | | 18.114 | 0,03 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 16.101 | | 13.481 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.06.2047 | | 25.147 | | 24.412 | 0,03 |
| 2,624 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 11.245 | | 9.471 | 0,01 |
| 2,634 % fällig am 25.05.2037 | | 19.052 | | 17.989 | 0,03 |
| 2,634 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 21.458 | | 15.631 | 0,02 |
| 2,634 % fällig am 25.10.2047 | | 21.874 | | 21.169 | 0,03 |
| 2,654 % fällig am 25.01.2046 ^ | | 25.075 | | 24.120 | 0,03 |
| 2,654 % fällig am 25.06.2047 | | 19.800 | | 18.805 | 0,03 |
| 2,664 % fällig am 25.09.2046 | | 3.189 | | 3.108 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 6.162 | | 3.691 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.09.2036 | | 3.062 | | 3.070 | 0,00 |
| 2,694 % fällig am 25.06.2036 | | 9.608 | | 9.613 | 0,01 |
| 2,694 % fällig am 25.07.2036 | | 4.182 | | 4.138 | 0,01 |
| 2,694 % fällig am 25.01.2037 | | 13.000 | | 11.697 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.06.2036 | | 982 | | 984 | 0,00 |
| 2,734 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 12.936 | | 9.772 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 11.513 | | 10.587 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.04.2036 | | 1.867 | | 1.870 | 0,00 |
| 2,754 % fällig am 25.08.2036 | | 7.759 | | 7.385 | 0,01 |
| 2,774 % fällig am 25.07.2036 | | 2.908 | | 2.566 | 0,00 |
| 2,794 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 3.260 | | 2.768 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.06.2036 | | 5.000 | | 4.960 | 0,01 |
| 2,839 % fällig am 25.01.2045 ^ | | 4.000 | | 3.521 | 0,01 |
| 2,844 % fällig am 25.04.2036 | | 20.710 | | 20.791 | 0,03 |
| 2,854 % fällig am 25.03.2047 ^ | | 478 | | 363 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.04.2036 | | 17.721 | | 16.860 | 0,02 |
| 2,874 % fällig am 25.02.2036 | | 1.433 | | 1.436 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 25.04.2036 | | 5.237 | | 5.055 | 0,01 |
| 2,924 % fällig am 25.01.2036 | | 2.505 | | 2.519 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 5.955 | | 5.560 | 0,01 |
| 3,054 % fällig am 25.01.2036 | | 9.140 | | 8.814 | 0,01 |
| 3,109 % fällig am 25.09.2035 | | 1.175 | | 1.152 | 0,00 |
| 3,114 % fällig am 25.07.2035 | | 10.417 | | 10.468 | 0,01 |
| 3,154 % fällig am 25.05.2034 | | 1.985 | | 1.991 | 0,00 |
| 3,164 % fällig am 25.01.2036 | | 3.000 | | 2.915 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.02.2036 | | 6.069 | | 6.131 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.12.2035 | | 1.660 | | 1.675 | 0,00 |
| 3,379 % fällig am 25.12.2035 | | 1.500 | | 1.527 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.10.2034 | | 1.416 | | 1.463 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.02.2035 | | 14.180 | | 14.512 | 0,02 |
| 3,979 % fällig am 25.01.2034 | | 2.782 | | 2.786 | 0,00 |
| 4,054 % fällig am 25.06.2035 | | 3.477 | | 3.413 | 0,01 |
| 4,354 % fällig am 25.08.2035 | | 3.000 | | 3.088 | 0,00 |
| 4,651 % fällig am 25.10.2046 ^ | | 19.402 | | 18.512 | 0,03 |
| 4,763 % fällig am 25.07.2036 | | 5.717 | | 5.929 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 4,804 % fällig am 25.10.2034 | $ | 534 | $ 547 | 0,00 |
| 5,430 % fällig am 25.02.2033 ^ | | 619 | 585 | 0,00 |
| 5,805 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 907 | 822 | 0,00 |
| 5,971 % fällig am 25.09.2046 ^ | | 6.462 | 6.120 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2046 | | 726 | 719 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.03.2037 | | 716 | 712 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.06.2047 | | 35.095 | 34.368 | 0,05 |
| 2,644 % fällig am 25.02.2037 | | 14.900 | 14.683 | 0,02 |
| 2,644 % fällig am 25.03.2037 | | 22.977 | 21.922 | 0,03 |
| 2,644 % fällig am 25.03.2047 ^ | | 13.866 | 12.670 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.04.2046 ^ | | 11.460 | 11.252 | 0,02 |
| 2,664 % fällig am 25.09.2046 | | 29.209 | 27.991 | 0,04 |
| 2,854 % fällig am 25.04.2036 | | 13.445 | 13.476 | 0,02 |
| 2,884 % fällig am 25.05.2036 | | 13.300 | 13.092 | 0,02 |
| 2,904 % fällig am 25.10.2034 | | 5.471 | 5.452 | 0,01 |
| 2,934 % fällig am 25.05.2036 | | 14.800 | 14.251 | 0,02 |
| 3,034 % fällig am 25.08.2035 | | 2.419 | 2.426 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 4.000 | 3.661 | 0,01 |
| 3,104 % fällig am 25.11.2035 | | 6.353 | 6.390 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 25.08.2035 | | 1.794 | 1.626 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.05.2036 | | 15.615 | 5.404 | 0,01 |
| 3,134 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 2.200 | 2.198 | 0,00 |
| 3,144 % fällig am 25.08.2047 | | 28.144 | 27.961 | 0,04 |
| 3,204 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 11.978 | 10.612 | 0,01 |
| 3,244 % fällig am 25.10.2047 | | 563 | 564 | 0,00 |
| 3,259 % fällig am 25.05.2036 | | 2.567 | 2.583 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.04.2035 | | 1.148 | 1.173 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.05.2036 | | 350 | 348 | 0,00 |
| 3,409 % fällig am 25.10.2035 | | 12.000 | 12.065 | 0,02 |
| 3,469 % fällig am 25.10.2035 | | 7.500 | 7.212 | 0,01 |
| 3,499 % fällig am 25.12.2034 | | 4.629 | 4.665 | 0,01 |
| 3,754 % fällig am 25.04.2035 | | 3.400 | 3.446 | 0,01 |
| 3,979 % fällig am 25.03.2035 | | 2.000 | 1.915 | 0,00 |
| 4,054 % fällig am 25.12.2034 | | 3.914 | 4.010 | 0,01 |
| 4,354 % fällig am 25.08.2035 | | 9.460 | 9.526 | 0,01 |
| 4,504 % fällig am 25.08.2035 | | 1.419 | 904 | 0,00 |
| 5,115 % fällig am 25.10.2035 | | 1.250 | 1.190 | 0,00 |
| 5,171 % fällig am 25.03.2035 | | 10.034 | 10.262 | 0,01 |
| 5,633 % fällig am 25.06.2035 | | 6.897 | 7.273 | 0,01 |
| 5,989 % fällig am 25.10.2046 ^ | | 740 | 709 | 0,00 |
| 6,270 % fällig am 25.10.2046 ^ | | 10.817 | 9.218 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.** | | | | |
| 2,944 % fällig am 25.12.2034 | | 9.189 | 9.207 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 25.07.2034 | | 2.113 | 2.128 | 0,00 |
| 3,259 % fällig am 25.08.2034 | | 2.201 | 2.189 | 0,00 |
| 3,829 % fällig am 25.06.2034 | | 387 | 383 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Baked Securities Notes Trust** | | | | |
| 3,404 % fällig am 25.08.2047 | | 1.489 | 1.478 | 0,00 |
| **Crecera Americas LLC** | | | | |
| 7,078 % fällig am 30.11.2021 | CLP | 4.120.528 | 5.897 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Asset-Backed Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.09.2037 | $ | 539 | 530 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.02.2056 | | 242.313 | 223.866 | 0,31 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization CBO Ltd.** | | | | |
| 2,795 % fällig am 16.02.2041 | | 54.641 | 2.749 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.05.2036 | | 3.155 | 2.668 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.10.2036 | | 5.095 | 4.378 | 0,01 |
| 3,004 % fällig am 25.07.2035 | | 4.515 | 4.548 | 0,01 |
| 3,184 % fällig am 25.03.2034 | | 681 | 687 | 0,00 |
| 3,426 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 5.814 | 5.350 | 0,01 |
| 3,544 % fällig am 25.07.2036 | | 600 | 602 | 0,00 |
| 3,642 % fällig am 25.12.2035 | | 2.602 | 2.610 | 0,00 |
| 4,133 % fällig am 25.04.2037 | | 4.765 | 3.919 | 0,01 |
| 5,462 % fällig am 25.12.2037 | | 1.989 | 2.193 | 0,00 |
| 5,779 % fällig am 25.01.2033 ^ | | 448 | 436 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,816 % fällig am 25.03.2037 ^ | $ | 139 | $ 78 | 0,00 |
| 4,028 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.033 | 830 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.11.2036 | | 14.218 | 8.902 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 5.973 | 5.922 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.11.2036 | | 3.337 | 2.103 | 0,00 |
| 2,634 % fällig am 25.11.2036 | | 1.157 | 738 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.07.2036 | | 2.601 | 2.531 | 0,00 |
| 3,570 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 5.037 | 2.253 | 0,00 |
| **Crown Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,528 % fällig am 17.07.2028 | | 33.700 | 33.546 | 0,05 |
| **CSAB Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.11.2036 | | 9.386 | 2.615 | 0,00 |
| 5,858 % fällig am 25.05.2037 | | 6.591 | 2.915 | 0,00 |
| 5,898 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 990 | 439 | 0,00 |
| 6,080 % fällig am 25.09.2036 | | 2.956 | 1.766 | 0,00 |
| **CWHEQ Revolving Home Equity Loan Resuritization Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 15.12.2035 | | 19.679 | 19.320 | 0,03 |
| **CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 15.05.2036 | | 6.038 | 5.971 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 15.11.2035 | | 5.295 | 5.137 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 15.05.2036 | | 2.167 | 2.085 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 15.02.2036 | | 10.571 | 10.282 | 0,01 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | |
| 1,300 % fällig am 28.04.2029 | € | 3.100 | 3.534 | 0,01 |
| **Driver Australia Four Trust** | | | | |
| 2,185 % fällig am 21.08.2025 | AUD | 9.549 | 6.703 | 0,01 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | | |
| 0,880 % fällig am 15.01.2030 | € | 19.000 | 21.659 | 0,03 |
| **EFS Volunteer LLC** | | | | |
| 3,430 % fällig am 25.10.2035 | $ | 4.418 | 4.395 | 0,01 |
| **Ellington Loan Acquisition Trust** | | | | |
| 3,504 % fällig am 25.05.2037 | | 1.851 | 1.869 | 0,00 |
| **Encore Credit Receivables Trust** | | | | |
| 3,054 % fällig am 25.01.2036 | | 5.000 | 4.815 | 0,01 |
| 3,139 % fällig am 25.07.2035 | | 1.899 | 1.821 | 0,00 |
| 3,334 % fällig am 25.11.2035 | | 7.591 | 7.542 | 0,01 |
| 3,424 % fällig am 25.07.2035 | | 2.138 | 2.055 | 0,00 |
| **Equifirst Loan Securitization Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.04.2037 | | 2.520 | 2.418 | 0,00 |
| **EquiFirst Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 5,029 % fällig am 25.12.2034 | | 657 | 646 | 0,00 |
| 5,779 % fällig am 25.10.2034 | | 1.104 | 1.123 | 0,00 |
| **Euromax ABS Ltd.** | | | | |
| 0,107 % fällig am 18.04.2097 | € | 354 | 404 | 0,00 |
| **Evans Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 3,441 % fällig am 28.05.2028 | $ | 19.300 | 19.195 | 0,03 |
| **FAB CBO BV** | | | | |
| 0,468 % fällig am 20.08.2080 | € | 136 | 155 | 0,00 |
| 0,768 % fällig am 20.08.2080 | | 2.500 | 2.425 | 0,00 |
| **FAB UK Ltd.** | | | | |
| 1,365 % fällig am 06.12.2045 | £ | 3.785 | 4.591 | 0,01 |
| **FBR Securitization Trust** | | | | |
| 3,139 % fällig am 25.11.2035 | $ | 11.731 | 9.707 | 0,01 |
| **FCT Youni** | | | | |
| 0,008 % fällig am 25.04.2032 | € | 8.900 | 10.144 | 0,01 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,550 % fällig am 25.11.2036 | $ | 4.235 | 2.767 | 0,00 |
| 2,570 % fällig am 25.11.2036 | | 19.060 | 17.569 | 0,02 |
| 2,594 % fällig am 25.05.2036 | | 9.011 | 6.989 | 0,01 |
| 2,670 % fällig am 25.11.2036 | | 3.385 | 2.212 | 0,00 |
| **Finance America Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,424 % fällig am 25.11.2034 | | 543 | 502 | 0,00 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.12.2036 | | 13.420 | 12.922 | 0,02 |
| 2,544 % fällig am 25.09.2036 | | 201 | 200 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.08.2036 | | 429 | 387 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.03.2037 | | 870 | 582 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.04.2036 | | 6.908 | 6.761 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.06.2036 | | 3.752 | 3.600 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.11.2036 | | 24.961 | 24.498 | 0,03 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2036 | | 18.027 | 16.499 | 0,02 |
| 2,644 % fällig am 25.10.2036 | | 21.916 | 17.649 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.02.2036 | | 6.427 | 6.001 | 0,01 |
| 2,714 % fällig am 25.07.2036 | | 9.982 | 9.616 | 0,01 |
| 2,764 % fällig am 25.10.2035 | $ | 2.242 | $ 2.241 | 0,00 |
| 2,764 % fällig am 25.11.2035 | | 4.078 | 3.968 | 0,01 |
| 2,854 % fällig am 25.11.2036 | | 897 | 902 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.01.2036 | | 7.774 | 7.460 | 0,01 |
| 2,894 % fällig am 25.07.2035 | | 4.700 | 4.732 | 0,01 |
| 2,990 % fällig am 25.03.2036 | | 11.797 | 11.744 | 0,02 |
| 3,079 % fällig am 25.11.2035 | | 356 | 356 | 0,00 |
| 3,109 % fällig am 25.05.2036 | | 5.370 | 5.358 | 0,01 |
| 3,139 % fällig am 25.12.2034 | | 1.427 | 1.483 | 0,00 |
| 3,229 % fällig am 25.06.2034 | | 2.971 | 2.961 | 0,00 |
| 3,349 % fällig am 25.09.2035 | | 8.653 | 6.890 | 0,01 |
| 3,829 % fällig am 25.10.2034 | | 969 | 968 | 0,00 |
| 4,204 % fällig am 25.09.2034 | | 1.708 | 1.722 | 0,00 |
| **First NLC Trust** | | | | |
| 2,474 % fällig am 25.08.2037 | | 8.100 | 5.162 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.08.2037 | | 125 | 80 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.08.2037 | | 4.504 | 2.916 | 0,00 |
| 2,894 % fällig am 25.02.2036 | | 8.851 | 6.068 | 0,01 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 2,530 % fällig am 25.08.2036 | | 8.155 | 3.541 | 0,01 |
| 2,539 % fällig am 25.10.2036 | | 17.846 | 16.813 | 0,02 |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 | | 28.727 | 18.516 | 0,03 |
| 2,544 % fällig am 25.02.2037 | | 21.405 | 16.580 | 0,02 |
| 2,554 % fällig am 25.10.2036 | | 15.605 | 7.762 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.02.2036 | | 7.303 | 6.982 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.04.2036 | | 5.422 | 5.257 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.11.2036 | | 8.291 | 3.869 | 0,01 |
| 2,634 % fällig am 25.01.2036 | | 11.176 | 11.190 | 0,02 |
| 2,674 % fällig am 25.02.2036 | | 300 | 254 | 0,00 |
| 2,734 % fällig am 25.01.2036 | | 2.402 | 2.350 | 0,00 |
| 2,744 % fällig am 25.11.2035 | | 1.451 | 1.458 | 0,00 |
| 2,814 % fällig am 25.11.2035 | | 7.629 | 6.982 | 0,01 |
| 2,854 % fällig am 25.01.2036 | | 5.941 | 4.793 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 25.06.2035 | | 253 | 254 | 0,00 |
| 3,154 % fällig am 25.06.2035 | | 3.500 | 3.497 | 0,01 |
| 3,184 % fällig am 25.07.2035 | | 4.190 | 4.045 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.07.2035 | | 2.676 | 2.336 | 0,00 |
| 3,424 % fällig am 25.01.2035 | | 5.018 | 4.940 | 0,01 |
| 3,469 % fällig am 25.06.2035 | | 5.561 | 5.559 | 0,01 |
| 4,159 % fällig am 25.05.2034 ^ | | 415 | 406 | 0,00 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | |
| 3,647 % fällig am 15.07.2027 | | 50.300 | 50.270 | 0,07 |
| **GE-WMC Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,534 % fällig am 25.08.2036 | | 13.506 | 13.307 | 0,02 |
| **Goodgreen Trust** | | | | |
| 3,930 % fällig am 15.10.2053 | | 25.056 | 26.155 | 0,04 |
| **Greenpoint Manufactured Housing Contract Trust Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,653 % fällig am 20.04.2032 | | 1.586 | 1.573 | 0,00 |
| **Greystone Commercial Real Estate Ltd.** | | | | |
| 5,144 % fällig am 15.03.2027 | | 6.000 | 5.961 | 0,01 |
| **Groupe Novasep** | | | | |
| 11,000 % fällig am 30.10.2021 | | 2.912 | 2.817 | 0,00 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 2,454 % fällig am 25.09.2036 | | 5.238 | 2.237 | 0,00 |
| 2,454 % fällig am 25.12.2046 | | 4.334 | 2.919 | 0,00 |
| 2,464 % fällig am 25.11.2036 | | 6.580 | 2.830 | 0,00 |
| 2,474 % fällig am 25.12.2046 | | 9.825 | 4.986 | 0,01 |
| 2,484 % fällig am 25.02.2037 | | 5.792 | 2.872 | 0,00 |
| 2,494 % fällig am 25.07.2036 | | 1.669 | 729 | 0,00 |
| 2,504 % fällig am 25.03.2037 | | 10.424 | 4.938 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.06.2036 | | 5.739 | 2.485 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.09.2036 | | 7.128 | 3.115 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.03.2036 | | 15.732 | 7.941 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.12.2036 | | 16.411 | 7.616 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.03.2036 | | 8.629 | 4.986 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.11.2036 | | 6.341 | 3.526 | 0,01 |
| 2,784 % fällig am 25.01.2036 | | 465 | 59 | 0,00 |
| 2,884 % fällig am 25.10.2035 | | 7.770 | 7.273 | 0,01 |
| 2,894 % fällig am 25.06.2035 | | 4.485 | 4.276 | 0,01 |
| 3,034 % fällig am 25.08.2035 | | 4.304 | 3.978 | 0,01 |
| 5,788 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 7.873 | 5.066 | 0,01 |
| 5,800 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 6.752 | 2.540 | 0,00 |
| 5,876 % fällig am 25.09.2036 | | 886 | 424 | 0,00 |
| 5,917 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 2.682 | 937 | 0,00 |
| 5,959 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 5.932 | 2.838 | 0,00 |
| 5,983 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 6.590 | 3.017 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.08.2047 ^ | | 557 | 550 | 0,00 |
| 6,099 % fällig am 25.03.2037 | | 2.497 | 946 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.08.2047 | | 1.619 | 1.268 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **GSAA Trust** | | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.03.2047 | $ | 25.292 | $ | 12.087 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.05.2047 | | 225 | | 183 | 0,00 |
| 5,058 % fällig am 25.05.2035 | | 645 | | 680 | 0,00 |
| 6,205 % fällig am 25.03.2046 ^ | | 874 | | 870 | 0,00 |
| **GSAMP Trust** | | | | | |
| 2,454 % fällig am 25.12.2046 | | 415 | | 258 | 0,00 |
| 2,504 % fällig am 25.12.2046 | | 1.865 | | 1.170 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.09.2036 | | 21.783 | | 10.466 | 0,01 |
| 2,524 % fällig am 25.12.2036 | | 6.404 | | 3.797 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.06.2036 | | 3.421 | | 3.372 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.03.2047 | | 10.206 | | 9.851 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.08.2036 | | 7.676 | | 7.502 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.12.2046 | | 629 | | 398 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.04.2036 | | 7.076 | | 5.269 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | | 21.824 | | 15.104 | 0,02 |
| 2,564 % fällig am 25.05.2046 | | 3.445 | | 3.414 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 | | 9.375 | | 5.599 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | | 14.342 | | 13.967 | 0,02 |
| 2,634 % fällig am 25.12.2046 | | 928 | | 594 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.10.2046 | | 6.000 | | 4.751 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.02.2046 | | 1.073 | | 1.038 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.03.2047 | | 13.410 | | 12.575 | 0,02 |
| 2,704 % fällig am 25.12.2036 | | 1.720 | | 1.673 | 0,00 |
| 2,774 % fällig am 25.03.2047 | | 3.302 | | 2.980 | 0,00 |
| 2,794 % fällig am 25.01.2036 | | 5.900 | | 5.901 | 0,01 |
| 2,814 % fällig am 25.01.2036 | | 2.504 | | 2.135 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 7.719 | | 7.601 | 0,01 |
| 3,049 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 7.680 | | 5.868 | 0,01 |
| 3,274 % fällig am 25.11.2034 | | 2.276 | | 2.281 | 0,00 |
| 3,289 % fällig am 25.07.2045 ^ | | 10.697 | | 10.482 | 0,01 |
| 3,379 % fällig am 25.04.2035 ^ | | 3.624 | | 3.574 | 0,01 |
| 3,454 % fällig am 25.06.2034 | | 455 | | 451 | 0,00 |
| **Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.** | | | | | |
| 3,681 % fällig am 20.04.2027 | | 46.423 | | 46.299 | 0,06 |
| 3,692 % fällig am 22.10.2025 | | 39.157 | | 39.165 | 0,05 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 11.300 | | 12.870 | 0,02 |
| 1,100 % fällig am 18.11.2029 | | 2.500 | | 2.850 | 0,00 |
| **Hildene CLO Ltd.** | | | | | |
| 4,143 % fällig am 10.10.2038 | $ | 29.959 | | 29.585 | 0,04 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.11.2036 | | 4.138 | | 3.913 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.10.2036 | | 7.500 | | 3.023 | 0,00 |
| 2,844 % fällig am 25.04.2036 | | 5.037 | | 3.825 | 0,01 |
| 2,854 % fällig am 25.02.2036 | | 5.200 | | 5.098 | 0,01 |
| 2,874 % fällig am 25.01.2036 | | 6.247 | | 6.005 | 0,01 |
| 3,199 % fällig am 25.11.2035 | | 5.000 | | 5.005 | 0,01 |
| 3,244 % fällig am 25.01.2035 | | 840 | | 857 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.12.2034 | | 521 | | 520 | 0,00 |
| 3,349 % fällig am 25.11.2035 | | 409 | | 391 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.11.2034 | | 871 | | 864 | 0,00 |
| 3,499 % fällig am 25.01.2035 | | 175 | | 174 | 0,00 |
| 3,604 % fällig am 25.10.2033 | | 1.420 | | 1.429 | 0,00 |
| 3,649 % fällig am 25.05.2035 | | 2.229 | | 2.019 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.03.2035 | | 867 | | 870 | 0,00 |
| 4,054 % fällig am 25.12.2034 | | 894 | | 907 | 0,00 |
| 4,104 % fällig am 25.11.2034 | | 646 | | 655 | 0,00 |
| 4,154 % fällig am 25.11.2034 | | 501 | | 491 | 0,00 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.04.2037 | | 8.334 | | 6.196 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.11.2036 | | 9.147 | | 8.762 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.11.2036 | | 6.354 | | 5.227 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.04.2037 | | 4.448 | | 3.329 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.06.2036 | | 6.630 | | 6.494 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.06.2036 | | 294 | | 290 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.04.2037 | | 13.331 | | 10.141 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2036 | | 9.788 | | 8.876 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.11.2036 | | 722 | | 600 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.04.2037 | | 14.503 | | 11.104 | 0,02 |
| 2,844 % fällig am 25.03.2036 | | 8.461 | | 8.131 | 0,01 |
| 3,649 % fällig am 25.03.2035 | | 5.320 | | 5.463 | 0,01 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.12.2036 | | 12.014 | | 4.863 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.12.2036 | | 4.081 | | 3.280 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.02.2036 | | 792 | | 792 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.01.2037 | | 19.424 | | 15.506 | 0,02 |
| 2,624 % fällig am 25.12.2036 | | 25.015 | | 12.240 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.05.2037 | | 9.587 | | 9.142 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.04.2037 | | 15.344 | | 10.395 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.02.2036 | | 2.065 | | 1.836 | 0,00 |
| 2,814 % fällig am 25.01.2036 | | 14.155 | | 13.733 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ICG U.S. CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,451 % fällig am 16.01.2028 | $ | 18.600 | $ | 18.517 | 0,03 |
| **IndyMac Manufactured Housing Contract Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 25.02.2028 | | 34 | | 35 | 0,00 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.05.2037 | | 24.097 | | 8.393 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | | 16.816 | | 8.221 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.09.2035 | | 726 | | 739 | 0,00 |
| **Jamestown CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,287 % fällig am 15.07.2026 | | 6.204 | | 6.189 | 0,01 |
| 3,467 % fällig am 15.01.2028 | | 45.383 | | 45.244 | 0,06 |
| 3,808 % fällig am 17.01.2027 | | 31.462 | | 31.500 | 0,04 |
| **JMP Credit Advisors CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,438 % fällig am 17.01.2028 | | 33.200 | | 33.048 | 0,05 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.03.2036 | | 11.141 | | 10.253 | 0,01 |
| 2,744 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 7.285 | | 7.181 | 0,01 |
| 2,764 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 2.711 | | 2.410 | 0,00 |
| 2,814 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 1.200 | | 1.174 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.05.2035 ^ | | 11.065 | | 10.455 | 0,01 |
| 2,834 % fällig am 25.10.2035 | | 6.528 | | 5.841 | 0,01 |
| 2,984 % fällig am 25.01.2036 | | 1.036 | | 1.031 | 0,00 |
| 3,154 % fällig am 25.06.2035 | | 9.869 | | 9.798 | 0,01 |
| 3,424 % fällig am 25.07.2035 | | 5.326 | | 5.393 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | | |
| 2,484 % fällig am 25.12.2036 | | 4.070 | | 2.624 | 0,00 |
| 2,494 % fällig am 25.07.2036 | | 677 | | 389 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.07.2036 | | 741 | | 740 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.03.2047 | | 1.046 | | 1.048 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.12.2036 | | 7.436 | | 4.854 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | | 3.192 | | 3.194 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2036 | | 1.814 | | 1.810 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.03.2047 | | 7.830 | | 7.691 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.12.2036 | | 12.181 | | 8.038 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.05.2036 | | 5.229 | | 5.238 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.11.2036 | | 6.902 | | 6.017 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.05.2037 | | 21.907 | | 21.379 | 0,03 |
| 2,664 % fällig am 25.07.2036 | | 5.626 | | 5.556 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.01.2037 | | 7.748 | | 7.720 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.03.2037 | | 7.313 | | 7.255 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.06.2037 | | 24.979 | | 24.665 | 0,03 |
| 2,674 % fällig am 25.05.2036 | | 3.567 | | 3.467 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.07.2036 | | 5.415 | | 5.263 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.08.2036 | | 6.700 | | 6.174 | 0,01 |
| 2,694 % fällig am 25.05.2036 | | 8.470 | | 7.907 | 0,01 |
| 2,694 % fällig am 25.07.2036 | | 3.250 | | 3.211 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.07.2036 | | 6.773 | | 5.696 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.01.2037 | | 336 | | 321 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.03.2037 | | 6.347 | | 5.994 | 0,01 |
| 3,404 % fällig am 25.11.2036 | | 5.085 | | 5.087 | 0,01 |
| 4,686 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 4.001 | | 2.915 | 0,00 |
| 6,130 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 12.861 | | 6.305 | 0,01 |
| **Kodiak CDO Ltd.** | | | | | |
| 3,045 % fällig am 07.08.2037 | | 13.325 | | 13.125 | 0,02 |
| **KVK CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,497 % fällig am 14.01.2028 | | 30.800 | | 30.661 | 0,04 |
| **Legacy Mortgage Asset Trust** | | | | | |
| 3,162 % fällig am 25.12.2056 | | 184.265 | | 170.312 | 0,23 |
| 4,001 % fällig am 25.01.2058 | | 38.189 | | 39.285 | 0,05 |
| 4,101 % fällig am 26.08.2058 | | 159.133 | | 163.526 | 0,22 |
| 4,157 % fällig am 25.02.2058 | | 14.158 | | 14.454 | 0,02 |
| 4,693 % fällig am 26.12.2057 | | 139.884 | | 144.184 | 0,20 |
| **Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust** | | | | | |
| 6,630 % fällig am 15.04.2040 | | 8.037 | | 8.551 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.05.2036 | | 7.602 | | 7.756 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.10.2036 | | 1.752 | | 1.608 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 | | 7.368 | | 6.560 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | | 1.603 | | 1.555 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.06.2036 | | 43 | | 37 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.02.2037 | | 18.513 | | 17.856 | 0,02 |
| 2,614 % fällig am 25.06.2046 | | 11.566 | | 11.399 | 0,02 |
| 2,634 % fällig am 25.02.2037 | | 10.711 | | 7.276 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.05.2046 ^ | | 2.933 | | 2.708 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.02.2047 | | 5.458 | | 5.147 | 0,01 |
| 2,714 % fällig am 25.03.2037 | | 5.312 | | 4.472 | 0,01 |
| 2,984 % fällig am 25.09.2036 | | 9.707 | | 8.346 | 0,01 |
| 5,890 % fällig am 25.04.2036 ^ | | 291 | | 285 | 0,00 |
| 6,290 % fällig am 24.06.2046 | | 5.057 | | 5.045 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **LMREC, Inc.** | | | | | |
| 3,408 % fällig am 22.02.2032 | $ | 19.800 | $ | 19.758 | 0,03 |
| 4,181 % fällig am 24.11.2031 | | 21.871 | | 21.921 | 0,03 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,494 % fällig am 25.09.2036 | | 16.307 | | 6.786 | 0,01 |
| 2,504 % fällig am 25.07.2036 | | 7.813 | | 4.021 | 0,01 |
| 2,514 % fällig am 25.11.2036 | | 409 | | 184 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.08.2036 | | 25.427 | | 13.257 | 0,02 |
| 2,549 % fällig am 25.07.2036 | | 7.502 | | 5.904 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.05.2036 | | 13.743 | | 9.187 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 3.038 | | 1.581 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.11.2036 | | 21.520 | | 16.692 | 0,02 |
| 2,564 % fällig am 25.05.2036 | | 14.046 | | 6.250 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.08.2036 | | 3.230 | | 1.697 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2036 | | 12.227 | | 5.164 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.10.2036 | | 10.604 | | 4.646 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.12.2036 | | 35.134 | | 26.832 | 0,04 |
| 2,564 % fällig am 25.05.2046 | | 23.888 | | 21.701 | 0,03 |
| 2,584 % fällig am 25.03.2046 | | 32.373 | | 26.173 | 0,04 |
| 2,594 % fällig am 25.03.2046 | | 3.170 | | 1.513 | 0,00 |
| 2,634 % fällig am 25.12.2036 | | 643 | | 321 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.08.2036 | | 3.981 | | 2.124 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.01.2036 | | 8.832 | | 8.399 | 0,01 |
| 2,704 % fällig am 25.02.2036 | | 15.345 | | 13.406 | 0,02 |
| 2,884 % fällig am 25.01.2046 | | 65 | | 65 | 0,00 |
| 2,924 % fällig am 25.08.2045 | | 865 | | 849 | 0,00 |
| 2,964 % fällig am 25.10.2034 | | 8.002 | | 7.870 | 0,01 |
| 3,164 % fällig am 25.08.2045 | | 2.476 | | 2.498 | 0,00 |
| 3,184 % fällig am 25.08.2035 | | 15.323 | | 15.251 | 0,02 |
| 3,454 % fällig am 25.06.2035 | | 7.875 | | 7.901 | 0,01 |
| 3,554 % fällig am 25.09.2034 | | 2.352 | | 2.490 | 0,00 |
| 3,829 % fällig am 25.02.2035 | | 13.104 | | 12.875 | 0,02 |
| **Loomis Sayles CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.04.2028 | | 33.187 | | 33.021 | 0,05 |
| **LP Credit Card ABS Master Trust** | | | | | |
| 4,053 % fällig am 20.08.2024 | | 19.705 | | 19.523 | 0,03 |
| **M360 Advisors LLC** | | | | | |
| 4,395 % fällig am 24.07.2028 | | 29.676 | | 29.749 | 0,04 |
| **MAPS Ltd.** | | | | | |
| 4,212 % fällig am 15.05.2043 | | 36.412 | | 37.354 | 0,05 |
| **Marlette Funding Trust** | | | | | |
| 3,710 % fällig am 15.12.2028 | | 6.680 | | 6.749 | 0,01 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 2,454 % fällig am 25.10.2036 | | 4.871 | | 2.147 | 0,00 |
| 2,504 % fällig am 25.08.2036 | | 10.491 | | 5.075 | 0,01 |
| 2,504 % fällig am 25.10.2036 | | 7.442 | | 4.659 | 0,01 |
| 2,534 % fällig am 25.10.2036 | | 475 | | 285 | 0,00 |
| 2,539 % fällig am 25.08.2036 | | 9.568 | | 5.159 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.04.2036 | | 2.591 | | 1.097 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | | 2.885 | | 1.644 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.08.2036 | | 17.500 | | 8.669 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.10.2036 | | 1.146 | | 515 | 0,00 |
| 2,564 % fällig am 25.10.2036 | | 9.743 | | 6.164 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.10.2036 | | 4.872 | | 4.804 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.11.2036 | | 11.991 | | 8.519 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.03.2036 | | 4.649 | | 3.412 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 7.314 | | 6.998 | 0,01 |
| 2,904 % fällig am 25.11.2035 | | 2.389 | | 1.712 | 0,00 |
| 2,974 % fällig am 25.01.2036 | | 6.590 | | 6.520 | 0,01 |
| 3,094 % fällig am 25.03.2035 | | 7.947 | | 7.998 | 0,01 |
| 3,104 % fällig am 25.09.2034 | | 3.602 | | 3.593 | 0,01 |
| 3,409 % fällig am 25.03.2035 | | 2.600 | | 2.627 | 0,00 |
| 3,554 % fällig am 25.08.2037 | | 10.284 | | 9.257 | 0,01 |
| 4,129 % fällig am 25.06.2035 | | 941 | | 943 | 0,00 |
| 4,939 % fällig am 25.06.2035 | | 2.496 | | 2.454 | 0,00 |
| **MASTR Specialized Loan Trust** | | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.06.2046 | | 3.256 | | 3.123 | 0,00 |
| 2,774 % fällig am 25.01.2037 | | 5.109 | | 2.890 | 0,00 |
| 4,404 % fällig am 25.07.2035 | | 745 | | 722 | 0,00 |
| **Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.06.2037 | | 1.028 | | 848 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.07.2037 | | 7.886 | | 4.370 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.05.2037 | | 6.503 | | 3.866 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.08.2037 | | 24.704 | | 19.900 | 0,03 |
| 2,574 % fällig am 25.07.2037 | | 5.070 | | 2.844 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.04.2047 | | 628 | | 390 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.07.2037 | | 442 | | 181 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.03.2037 | | 3.331 | | 1.564 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.07.2037 | | 2.796 | | 1.597 | 0,00 |
| 2,714 % fällig am 25.08.2036 | | 3.003 | | 3.010 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| 2,804 % fällig am 25.12.2036 | $ 5.111 | $ 4.378 | 0,01 |
| 2,854 % fällig am 25.02.2047 | 295 | 217 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.10.2035 | 2.594 | 2.630 | 0,00 |
| 3,154 % fällig am 25.08.2036 | 10.311 | 10.507 | 0,01 |
| 3,409 % fällig am 25.06.2036 | 4.439 | 3.810 | 0,01 |
| 3,484 % fällig am 25.10.2035 | 454 | 454 | 0,00 |
| **METAL Cayman Ltd.** | | | |
| 4,581 % fällig am 15.10.2042 | 43.160 | 43.648 | 0,06 |
| **MMcapS Funding Ltd.** | | | |
| 2,870 % fällig am 01.12.2035 | 3.271 | 3.189 | 0,00 |
| **Monarch Grove CLO** | | | |
| 3,460 % fällig am 25.01.2028 | 36.300 | 36.146 | 0,05 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,454 % fällig am 25.07.2036 | 8.341 | 4.088 | 0,01 |
| 2,474 % fällig am 25.10.2036 | 3.841 | 2.401 | 0,00 |
| 2,494 % fällig am 25.01.2037 | 20.971 | 11.840 | 0,02 |
| 2,504 % fällig am 25.10.2036 | 1.807 | 1.111 | 0,00 |
| 2,514 % fällig am 25.10.2036 | 5.218 | 3.280 | 0,00 |
| 2,514 % fällig am 25.12.2036 | 5.038 | 3.112 | 0,00 |
| 2,514 % fällig am 25.02.2037 | 3.878 | 1.831 | 0,00 |
| 2,529 % fällig am 25.07.2036 | 13.320 | 11.679 | 0,02 |
| 2,544 % fällig am 25.10.2036 | 18.604 | 11.506 | 0,02 |
| 2,544 % fällig am 25.05.2037 | 38.834 | 32.850 | 0,05 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | 4.660 | 3.062 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | 4.415 | 2.223 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.12.2036 | 14.895 | 9.244 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.02.2037 | 6.402 | 3.880 | 0,01 |
| 2,614 % fällig am 25.01.2037 | 6.684 | 3.831 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.06.2036 | 35.154 | 26.563 | 0,04 |
| 2,654 % fällig am 25.04.2036 | 15.655 | 15.026 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.07.2036 | 2.095 | 1.083 | 0,00 |
| 2,664 % fällig am 25.02.2037 | 1.106 | 680 | 0,00 |
| 2,734 % fällig am 25.03.2036 | 12.438 | 8.089 | 0,01 |
| 2,734 % fällig am 25.02.2037 | 16.737 | 10.388 | 0,01 |
| 2,784 % fällig am 25.12.2035 | 9.471 | 8.274 | 0,01 |
| 2,834 % fällig am 25.11.2035 | 790 | 727 | 0,00 |
| 3,064 % fällig am 25.01.2035 | 6.041 | 6.049 | 0,01 |
| 3,064 % fällig am 25.11.2035 | 9.500 | 9.313 | 0,01 |
| 3,079 % fällig am 25.12.2034 | 1.663 | 1.647 | 0,00 |
| 3,079 % fällig am 25.09.2035 | 633 | 607 | 0,00 |
| 3,109 % fällig am 25.12.2034 | 664 | 636 | 0,00 |
| 3,144 % fällig am 25.01.2034 | 3.780 | 3.801 | 0,01 |
| 3,319 % fällig am 25.03.2035 | 2.625 | 2.645 | 0,00 |
| 3,334 % fällig am 25.11.2034 | 4.103 | 4.096 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.02.2035 | 4.226 | 4.119 | 0,01 |
| 3,349 % fällig am 25.01.2035 | 5.546 | 5.375 | 0,01 |
| 3,379 % fällig am 25.04.2035 | 3.580 | 3.634 | 0,01 |
| 3,404 % fällig am 25.07.2037 | 22.850 | 22.757 | 0,03 |
| 3,424 % fällig am 25.08.2034 | 477 | 480 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.04.2035 | 292 | 287 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.06.2035 ^ | 3.750 | 3.574 | 0,01 |
| 4,204 % fällig am 25.05.2034 | 1.918 | 1.879 | 0,00 |
| 5,029 % fällig am 25.03.2034 | 794 | 784 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,694 % fällig am 25.01.2036 | 3.475 | 3.442 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.04.2036 | 10.246 | 8.157 | 0,01 |
| 2,744 % fällig am 25.02.2036 | 9.744 | 9.338 | 0,01 |
| 3,109 % fällig am 25.08.2035 | 2.850 | 2.865 | 0,00 |
| **Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust** | | | |
| 2,474 % fällig am 25.11.2036 | 8.436 | 4.193 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | 17.315 | 9.080 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.11.2036 | 6.937 | 3.484 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,484 % fällig am 25.11.2036 | 1.683 | 692 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.11.2036 | 1.795 | 747 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2047 ^ | 4.665 | 2.018 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.04.2037 | 4.789 | 2.251 | 0,00 |
| 2,744 % fällig am 25.10.2036 | 10.793 | 5.154 | 0,01 |
| 2,944 % fällig am 25.04.2037 | 20.478 | 10.560 | 0,01 |
| 5,577 % fällig am 25.10.2046 ^ | 5.267 | 2.210 | 0,00 |
| 5,763 % fällig am 25.01.2047 | 1.546 | 797 | 0,00 |
| 5,798 % fällig am 25.10.2036 ^ | 11.184 | 4.850 | 0,01 |
| 5,988 % fällig am 25.11.2036 ^ | 7.484 | 3.208 | 0,00 |
| 6,250 % fällig am 25.02.2037 | 4.483 | 3.526 | 0,01 |
| **Morgan Stanley Structured Trust** | | | |
| 2,634 % fällig am 25.06.2037 | 12.201 | 12.051 | 0,02 |
| **Mountain Hawk CLO Ltd.** | | | |
| 3,412 % fällig am 20.07.2024 | 14.215 | 14.211 | 0,02 |
| **Mountain View CLO Ltd.** | | | |
| 3,417 % fällig am 13.10.2027 | 29.300 | 29.193 | 0,04 |
| 3,587 % fällig am 15.10.2026 | 9.195 | 9.163 | 0,01 |
| **National Collegiate Student Loan Trust** | | | |
| 2,634 % fällig am 26.03.2029 | $ 9.701 | $ 9.642 | 0,01 |
| 2,644 % fällig am 25.07.2030 | 14.191 | 14.081 | 0,02 |
| 2,674 % fällig am 26.03.2029 | 12.633 | 12.572 | 0,02 |
| 2,674 % fällig am 25.09.2029 | 247 | 247 | 0,00 |
| 2,714 % fällig am 25.05.2032 | 21.236 | 20.240 | 0,03 |
| 2,724 % fällig am 27.10.2031 | 36.000 | 33.712 | 0,05 |
| 2,729 % fällig am 25.06.2029 | 7.049 | 6.982 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.03.2033 | 25.151 | 23.783 | 0,03 |
| 2,774 % fällig am 25.06.2033 | 10.000 | 9.531 | 0,01 |
| **Nationstar Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.06.2037 | 2.248 | 2.246 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.09.2036 | 447 | 447 | 0,00 |
| **Navient Private Education Loan Trust** | | | |
| 2,650 % fällig am 15.12.2028 | 15.714 | 15.791 | 0,02 |
| 2,740 % fällig am 15.02.2029 | 7.076 | 7.144 | 0,01 |
| 4,544 % fällig am 15.12.2045 | 17.605 | 18.161 | 0,03 |
| **NelNet Student Loan Trust** | | | |
| 4,171 % fällig am 25.11.2024 | 18.652 | 18.664 | 0,03 |
| **Neuberger Berman CLO Ltd.** | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | 24.400 | 24.382 | 0,03 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 3,034 % fällig am 25.09.2035 | 12.600 | 12.512 | 0,02 |
| 3,079 % fällig am 25.03.2035 | 106 | 107 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.03.2035 | 184 | 182 | 0,00 |
| 3,349 % fällig am 25.06.2035 | 6.309 | 6.221 | 0,01 |
| 3,379 % fällig am 25.11.2034 | 459 | 463 | 0,00 |
| 3,379 % fällig am 25.06.2035 | 8.002 | 7.573 | 0,01 |
| 3,409 % fällig am 25.07.2035 | 12.000 | 11.915 | 0,02 |
| 3,469 % fällig am 25.03.2035 | 342 | 333 | 0,00 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,684 % fällig am 25.07.2036 | 15.544 | 13.408 | 0,02 |
| 2,724 % fällig am 25.03.2036 | 5.124 | 4.905 | 0,01 |
| 2,734 % fällig am 25.11.2035 | 7.542 | 7.449 | 0,01 |
| 2,734 % fällig am 25.03.2036 | 8.194 | 7.505 | 0,01 |
| 2,734 % fällig am 25.10.2036 ^ | 8.170 | 2.763 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.02.2037 ^ | 11.761 | 4.749 | 0,01 |
| 2,894 % fällig am 25.05.2035 | 1.746 | 1.758 | 0,00 |
| 5,992 % fällig am 25.02.2037 ^ | 6.291 | 2.920 | 0,00 |
| 6,032 % fällig am 25.10.2036 ^ | 3.049 | 1.196 | 0,00 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | 6.760 | 3.735 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.03.2037 | 3.911 | 1.917 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.09.2037 | 3.655 | 3.384 | 0,00 |
| 2,604 % fällig am 25.09.2037 | 23.889 | 23.324 | 0,03 |
| 2,704 % fällig am 25.06.2036 | 4.517 | 3.858 | 0,01 |
| 2,724 % fällig am 25.05.2036 | 10.173 | 10.052 | 0,01 |
| 3,064 % fällig am 25.01.2036 | 830 | 830 | 0,00 |
| 3,079 % fällig am 25.01.2036 | 442 | 442 | 0,00 |
| 3,094 % fällig am 25.01.2036 | 8.000 | 7.559 | 0,01 |
| 3,109 % fällig am 25.01.2036 | 3.700 | 3.698 | 0,01 |
| 3,139 % fällig am 25.01.2036 | 5.000 | 4.625 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 25.10.2035 | 6.311 | 6.374 | 0,01 |
| 3,229 % fällig am 25.06.2034 | 1.494 | 1.493 | 0,00 |
| 4,305 % fällig am 25.03.2035 | 6.821 | 6.862 | 0,01 |
| **Oakwood Mortgage Investors, Inc.** | | | |
| 5,050 % fällig am 15.12.2031 | 263 | 254 | 0,00 |
| 6,990 % fällig am 15.12.2026 | 886 | 916 | 0,00 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | 35.500 | 35.433 | 0,05 |
| **OneMain Financial Issuance Trust** | | | |
| 2,370 % fällig am 14.09.2032 | 69.000 | 68.881 | 0,09 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.03.2037 | 13.900 | 12.645 | 0,02 |
| 2,534 % fällig am 25.07.2037 | 6.522 | 4.716 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.01.2037 | 24.394 | 18.230 | 0,03 |
| 2,544 % fällig am 25.02.2037 | 28.362 | 20.825 | 0,03 |
| 2,544 % fällig am 25.03.2037 | 19.913 | 12.891 | 0,02 |
| 2,574 % fällig am 25.05.2037 | 27.368 | 16.957 | 0,02 |
| 2,584 % fällig am 25.04.2037 | 870 | 576 | 0,00 |
| 2,584 % fällig am 25.07.2037 | 6.512 | 4.741 | 0,01 |
| 2,594 % fällig am 25.01.2036 | 1.690 | 1.695 | 0,00 |
| 2,594 % fällig am 25.07.2037 | 2.899 | 2.657 | 0,00 |
| 2,624 % fällig am 25.01.2037 | 10.172 | 6.818 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.04.2037 | 49.562 | 39.491 | 0,05 |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | 7.306 | 5.065 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.03.2037 | 3.525 | 2.100 | 0,00 |
| 2,764 % fällig am 25.01.2036 | 27.947 | 25.764 | 0,04 |
| 3,139 % fällig am 25.08.2035 | 5.353 | 5.376 | 0,01 |
| **Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates** | | | |
| 2,794 % fällig am 25.12.2035 | $ 388 | $ 388 | 0,00 |
| **Orwell Park CLO Designated Activity Co.** | | | |
| 0,780 % fällig am 18.07.2029 | € 2.200 | 2.508 | 0,00 |
| **Ownit Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,352 % fällig am 25.12.2035 ^ | $ 1.334 | 855 | 0,00 |
| **Palmer Square Loan Funding Ltd.** | | | |
| 3,247 % fällig am 15.07.2026 | 38.962 | 38.737 | 0,05 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | |
| 2,894 % fällig am 25.09.2035 | 10.114 | 9.796 | 0,01 |
| 3,034 % fällig am 25.09.2035 | 6.441 | 6.119 | 0,01 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,894 % fällig am 25.08.2035 | 11.639 | 11.473 | 0,02 |
| 2,894 % fällig am 25.09.2035 | 15.965 | 15.967 | 0,02 |
| 3,199 % fällig am 25.07.2035 | 13.100 | 13.188 | 0,02 |
| 3,244 % fällig am 25.01.2036 | 1.455 | 1.461 | 0,00 |
| 3,349 % fällig am 25.06.2035 | 6.250 | 6.282 | 0,01 |
| 3,454 % fällig am 25.09.2034 | 3.244 | 3.269 | 0,00 |
| 3,454 % fällig am 25.06.2035 | 4.535 | 4.233 | 0,01 |
| 3,724 % fällig am 25.01.2036 ^ | 8.536 | 8.557 | 0,01 |
| 3,979 % fällig am 25.02.2035 | 19.347 | 19.764 | 0,03 |
| 4,174 % fällig am 25.10.2034 | 5.729 | 5.744 | 0,01 |
| 4,204 % fällig am 25.12.2034 | 17.617 | 18.334 | 0,03 |
| 4,279 % fällig am 25.12.2034 | 3.651 | 3.719 | 0,01 |
| 4,504 % fällig am 25.09.2034 | 121 | 123 | 0,00 |
| **People's Choice Home Loan Securities Trust** | | | |
| 2,924 % fällig am 25.12.2035 | 2.290 | 2.261 | 0,00 |
| 3,084 % fällig am 25.12.2035 ^ | 14.648 | 13.141 | 0,02 |
| 3,199 % fällig am 25.08.2035 | 1.776 | 1.762 | 0,00 |
| 3,259 % fällig am 25.08.2035 | 11.764 | 10.849 | 0,02 |
| 3,349 % fällig am 25.05.2035 ^ | 1.200 | 1.092 | 0,00 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,654 % fällig am 25.06.2047 ^ | 7.022 | 6.931 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.11.2036 | 5.861 | 5.804 | 0,01 |
| 2,794 % fällig am 25.02.2036 | 3.805 | 3.798 | 0,01 |
| 3,034 % fällig am 25.11.2035 | 1.891 | 1.899 | 0,00 |
| 3,986 % fällig am 25.11.2035 | 1.790 | 1.805 | 0,00 |
| **Project Silver** | | | |
| 3,967 % fällig am 15.07.2044 (c) | 21.500 | 21.500 | 0,03 |
| **Prosper Marketplace Issuance Trust** | | | |
| 3,350 % fällig am 15.10.2024 | 15.040 | 15.097 | 0,02 |
| **RAAC Trust** | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2036 | 2.748 | 2.721 | 0,00 |
| 2,704 % fällig am 25.06.2044 | 2.832 | 2.589 | 0,00 |
| 2,744 % fällig am 25.08.2036 | 2.140 | 2.166 | 0,00 |
| 2,784 % fällig am 25.10.2046 | 3.656 | 3.629 | 0,01 |
| 2,864 % fällig am 25.11.2036 | 2.451 | 2.454 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.02.2037 | 4.034 | 3.805 | 0,01 |
| 2,974 % fällig am 25.03.2037 | 3.964 | 3.969 | 0,01 |
| 3,054 % fällig am 25.06.2047 | 4.881 | 4.817 | 0,01 |
| 3,604 % fällig am 25.10.2045 | 2.464 | 2.497 | 0,00 |
| 4,154 % fällig am 25.06.2035 | 1.665 | 1.677 | 0,00 |
| **ReadyCap Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 6,254 % fällig am 25.05.2034 | 1.792 | 1.800 | 0,00 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | |
| 3,164 % fällig am 25.12.2032 | 53 | 54 | 0,00 |
| 5,285 % fällig am 25.01.2037 | 2.837 | 1.498 | 0,00 |
| 5,294 % fällig am 25.01.2037 | 18.606 | 9.844 | 0,01 |
| 5,357 % fällig am 25.05.2035 | 2.352 | 2.279 | 0,00 |
| 5,545 % fällig am 25.01.2037 | 2.376 | 1.317 | 0,00 |
| 5,675 % fällig am 25.06.2037 ^ | 421 | 182 | 0,00 |
| 5,731 % fällig am 25.11.2036 | 5.049 | 2.792 | 0,00 |
| 5,742 % fällig am 25.04.2037 | 4.529 | 2.104 | 0,00 |
| 5,744 % fällig am 25.06.2037 ^ | 5.934 | 2.596 | 0,00 |
| 5,762 % fällig am 25.08.2036 | 8.559 | 4.867 | 0,01 |
| 5,797 % fällig am 25.08.2036 | 13.308 | 7.612 | 0,01 |
| 5,812 % fällig am 25.11.2036 | 9.134 | 5.117 | 0,01 |
| 5,879 % fällig am 25.06.2037 ^ | 2.974 | 1.332 | 0,00 |
| 5,893 % fällig am 25.06.2037 ^ | 28.633 | 12.856 | 0,02 |
| 6,011 % fällig am 25.07.2034 | 2.387 | 2.354 | 0,00 |
| 6,120 % fällig am 25.11.2036 | 9.396 | 5.522 | 0,01 |
| 6,998 % fällig am 25.09.2037 ^ | 2.698 | 1.563 | 0,00 |
| 7,238 % fällig am 25.09.2037 ^ | 11.198 | 6.485 | 0,01 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.02.2037 | 1.441 | 1.438 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.08.2046 | 2.431 | 2.429 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.07.2036 | 9.203 | 9.152 | 0,01 |
| 2,744 % fällig am 25.12.2035 | 8.575 | 7.808 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,754 % fällig am 25.10.2036 | $ | 10.853 | $ 10.376 | 0,01 |
| 2,764 % fällig am 25.02.2036 | | 5.646 | 5.353 | 0,01 |
| 2,794 % fällig am 25.02.2036 | | 393 | 394 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.12.2035 | | 602 | 517 | 0,00 |
| 2,924 % fällig am 25.09.2035 | | 3.983 | 3.598 | 0,01 |
| 3,049 % fällig am 25.11.2035 | | 2.221 | 2.230 | 0,00 |
| 3,054 % fällig am 25.07.2035 | | 4.213 | 4.065 | 0,01 |
| 3,084 % fällig am 25.05.2035 | | 2.250 | 2.143 | 0,00 |
| 3,104 % fällig am 25.08.2035 | | 4.551 | 4.539 | 0,01 |
| 3,349 % fällig am 25.10.2035 | | 5.516 | 3.713 | 0,01 |
| 3,469 % fällig am 25.05.2035 | | 3.000 | 2.895 | 0,00 |
| 3,604 % fällig am 25.01.2035 ^ | | 4.692 | 3.895 | 0,01 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.11.2036 ^ | | 9.327 | 8.998 | 0,01 |
| 2,612 % fällig am 25.01.2037 | | 12.171 | 10.283 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.01.2037 | | 5.000 | 4.775 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.02.2037 | | 15.951 | 15.166 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.04.2037 | | 7.804 | 7.764 | 0,01 |
| 2,664 % fällig am 25.07.2036 | | 339 | 334 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.04.2036 | | 3.477 | 3.491 | 0,01 |
| 2,674 % fällig am 25.07.2036 | | 5.407 | 4.459 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.06.2036 | | 3.500 | 3.479 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.07.2036 | | 7.512 | 6.619 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.09.2036 | | 6.979 | 6.494 | 0,01 |
| 2,694 % fällig am 25.06.2036 | | 3.422 | 3.293 | 0,00 |
| 2,744 % fällig am 25.04.2036 | | 6.000 | 5.435 | 0,01 |
| 2,744 % fällig am 25.05.2037 | | 3.000 | 2.991 | 0,00 |
| 2,804 % fällig am 25.02.2036 | | 3.567 | 3.445 | 0,01 |
| 2,814 % fällig am 25.01.2036 | | 505 | 505 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.02.2036 | | 4.434 | 4.294 | 0,01 |
| 2,844 % fällig am 25.11.2035 | | 9.245 | 9.285 | 0,01 |
| 2,844 % fällig am 25.12.2035 | | 3.988 | 3.888 | 0,01 |
| 2,864 % fällig am 25.09.2035 | | 709 | 712 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 25.10.2035 | | 4.047 | 3.706 | 0,01 |
| 2,884 % fällig am 25.08.2035 | | 4.524 | 4.542 | 0,01 |
| 2,884 % fällig am 25.01.2036 | | 9.457 | 8.945 | 0,01 |
| 3,049 % fällig am 25.03.2035 | | 1.113 | 1.117 | 0,00 |
| 3,054 % fällig am 25.07.2035 | | 2.419 | 2.445 | 0,00 |
| 3,079 % fällig am 25.02.2035 | | 818 | 823 | 0,00 |
| 3,094 % fällig am 25.10.2035 | | 3.750 | 3.755 | 0,01 |
| 3,094 % fällig am 25.11.2035 | | 3.070 | 3.059 | 0,00 |
| 3,154 % fällig am 25.04.2034 | | 988 | 983 | 0,00 |
| 3,184 % fällig am 25.06.2034 | | 3.699 | 3.684 | 0,01 |
| 3,649 % fällig am 25.03.2035 | | 1.010 | 997 | 0,00 |
| 4,204 % fällig am 25.04.2035 | | 1.475 | 1.487 | 0,00 |
| 5,830 % fällig am 25.10.2034 | | 1.382 | 1.383 | 0,00 |
| **Residential Funding Mortgage Securities Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 5,400 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 1.999 | 972 | 0,00 |
| **RMF Buyout Issuance Trust** | | | | |
| 3,436 % fällig am 25.11.2028 | | 17.857 | 17.891 | 0,02 |
| **S-Jets Ltd.** | | | | |
| 3,967 % fällig am 15.08.2042 | | 43.841 | 44.797 | 0,06 |
| **Sapphire Aviation Finance Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.03.2040 | | 61.053 | 61.951 | 0,09 |
| **Saranac CLO Ltd.** | | | | |
| 3,443 % fällig am 22.06.2030 | | 36.360 | 36.438 | 0,05 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 13.674 | 12.264 | 0,02 |
| 2,714 % fällig am 25.09.2047 | | 22.058 | 21.536 | 0,03 |
| 2,804 % fällig am 25.09.2047 | | 5.000 | 4.788 | 0,01 |
| 2,884 % fällig am 25.11.2037 | | 2.500 | 2.380 | 0,00 |
| 2,894 % fällig am 25.09.2047 | | 5.418 | 4.873 | 0,01 |
| 3,064 % fällig am 25.10.2035 | | 5.398 | 5.301 | 0,01 |
| 3,274 % fällig am 25.08.2035 | | 5.584 | 5.647 | 0,01 |
| 4,154 % fällig am 25.12.2037 | | 10.973 | 10.616 | 0,01 |
| **SCF Reality Capital Funding LLC** | | | | |
| 4,100 % fällig am 25.06.2047 | | 21.684 | 22.028 | 0,03 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 2,484 % fällig am 25.08.2036 | | 3.278 | 1.477 | 0,00 |
| 2,544 % fällig am 25.05.2036 | | 9.900 | 6.327 | 0,01 |
| 2,544 % fällig am 25.06.2036 | | 895 | 714 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.03.2036 | | 3.322 | 2.333 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | | 7.304 | 3.662 | 0,01 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2036 | | 6.507 | 1.978 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.08.2036 ^ | | 14.498 | 6.629 | 0,01 |
| 2,604 % fällig am 25.05.2037 ^ | | 7.312 | 4.750 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.01.2037 | | 1.035 | 807 | 0,00 |
| 2,644 % fällig am 25.07.2036 | | 10.704 | 5.684 | 0,01 |
| 2,794 % fällig am 25.10.2035 | | 7.750 | 7.742 | 0,01 |
| 2,884 % fällig am 25.10.2035 | | 1.750 | 1.578 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,984 % fällig am 25.11.2035 | $ | 1.306 | $ 1.305 | 0,00 |
| 2,994 % fällig am 25.10.2035 | | 2.927 | 2.711 | 0,00 |
| 3,004 % fällig am 25.11.2035 | | 4.156 | 3.205 | 0,00 |
| 3,079 % fällig am 25.01.2035 | | 1.704 | 1.694 | 0,00 |
| 3,364 % fällig am 25.01.2036 ^ | | 1.649 | 1.316 | 0,00 |
| **SG Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.07.2036 | | 25.930 | 8.135 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.02.2036 | | 5.120 | 3.352 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.02.2036 | | 2.693 | 1.799 | 0,00 |
| 2,874 % fällig am 25.10.2035 | | 2.600 | 2.520 | 0,00 |
| 2,994 % fällig am 25.10.2035 | | 1.865 | 1.597 | 0,00 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | |
| 2,578 % fällig am 15.05.2029 | | 18.897 | 18.539 | 0,03 |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | | |
| 1,850 % fällig am 17.06.2030 | | 4.959 | 4.953 | 0,01 |
| 5,644 % fällig am 16.05.2044 | | 925 | 930 | 0,00 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,089 % fällig am 25.10.2039 | € | 3.803 | 4.204 | 0,01 |
| 0,232 % fällig am 15.12.2033 | | 3.596 | 3.970 | 0,01 |
| 0,239 % fällig am 25.07.2039 | | 19.187 | 21.242 | 0,03 |
| 0,239 % fällig am 25.01.2040 | | 24.600 | 26.199 | 0,04 |
| 1,339 % fällig am 15.03.2038 | £ | 34.865 | 42.733 | 0,06 |
| 2,730 % fällig am 25.10.2029 | $ | 21.706 | 21.471 | 0,03 |
| 3,180 % fällig am 25.10.2029 | | 98.675 | 98.208 | 0,13 |
| 4,080 % fällig am 25.04.2023 | | 28.601 | 28.916 | 0,04 |
| 4,280 % fällig am 25.07.2023 | | 14.810 | 14.997 | 0,02 |
| **SoFi Alternative Trust** | | | | |
| 4,008 % fällig am 15.06.2050 | | 73.598 | 77.029 | 0,11 |
| 4,570 % fällig am 16.05.2050 | | 74.599 | 78.205 | 0,11 |
| **SoFi Consumer Loan Program LLC** | | | | |
| 2,140 % fällig am 25.09.2026 | | 1.618 | 1.617 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 26.05.2026 | | 13.278 | 13.292 | 0,02 |
| 2,770 % fällig am 25.05.2026 | | 13.643 | 13.673 | 0,02 |
| 3,260 % fällig am 25.08.2025 | | 1.368 | 1.381 | 0,00 |
| **SoFi Consumer Loan Program Trust** | | | | |
| 2,200 % fällig am 25.11.2026 | | 3.858 | 3.856 | 0,01 |
| 2,550 % fällig am 25.02.2027 | | 5.345 | 5.343 | 0,01 |
| **SoFi Professional Loan Program LLC** | | | | |
| 3,354 % fällig am 25.01.2039 | | 501 | 503 | 0,00 |
| **Soloso CDO Ltd.** | | | | |
| 2,849 % fällig am 07.10.2037 | | 4.490 | 4.108 | 0,01 |
| **Sonic Capital LLC** | | | | |
| 4,026 % fällig am 20.02.2048 | | 9.942 | 10.226 | 0,01 |
| **Sorrento Park CLO DAC** | | | | |
| 1,200 % fällig am 16.11.2027 | € | 3.450 | 3.935 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.11.2036 | $ | 2.681 | 1.143 | 0,00 |
| 2,484 % fällig am 25.06.2037 | | 4.803 | 3.388 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2036 | | 1.637 | 1.639 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.03.2037 | | 10.558 | 10.220 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2037 | | 21.084 | 14.991 | 0,02 |
| 2,564 % fällig am 25.01.2037 | | 13.685 | 11.101 | 0,02 |
| 2,574 % fällig am 25.07.2037 | | 1.282 | 1.085 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.08.2037 | | 12.835 | 11.840 | 0,02 |
| 2,584 % fällig am 25.07.2037 | | 10.704 | 9.888 | 0,01 |
| 2,604 % fällig am 25.02.2037 | | 39.294 | 16.880 | 0,02 |
| 2,604 % fällig am 25.06.2037 | | 33.023 | 24.742 | 0,03 |
| 2,644 % fällig am 25.07.2036 | | 39.455 | 37.006 | 0,05 |
| 2,654 % fällig am 25.06.2036 | | 11.482 | 11.229 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.10.2036 | | 21.309 | 20.568 | 0,03 |
| 2,674 % fällig am 25.12.2036 | | 12.716 | 12.085 | 0,02 |
| 2,684 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 8.508 | 5.889 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.10.2036 | | 9.242 | 9.225 | 0,01 |
| 2,714 % fällig am 25.02.2036 | | 6.505 | 6.297 | 0,01 |
| 2,714 % fällig am 25.06.2036 ^ | | 11.591 | 8.397 | 0,01 |
| 2,749 % fällig am 25.03.2036 | | 10.000 | 8.239 | 0,01 |
| 2,864 % fällig am 25.12.2035 | | 14.683 | 13.549 | 0,02 |
| 3,054 % fällig am 25.03.2036 | | 7.161 | 4.130 | 0,01 |
| 3,244 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 7.266 | 6.764 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.10.2037 | | 25.722 | 21.541 | 0,03 |
| 3,354 % fällig am 25.09.2037 | | 2.526 | 2.424 | 0,00 |
| 3,404 % fällig am 25.09.2037 | | 6.090 | 4.914 | 0,01 |
| 3,504 % fällig am 25.09.2037 | | 2.281 | 2.191 | 0,00 |
| **Southern Pacific Secured Asset Corp.** | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.03.2028 | | 160 | 148 | 0,00 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 2,514 % fällig am 25.09.2037 | | 4.198 | 1.969 | 0,00 |
| 2,524 % fällig am 25.04.2037 | | 1.480 | 909 | 0,00 |
| 2,554 % fällig am 25.11.2037 | | 12.433 | 9.067 | 0,01 |
| 2,754 % fällig am 25.03.2037 | | 3.142 | 1.675 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,154 % fällig am 25.06.2036 | $ | 1.150 | $ 1.158 | 0,00 |
| 3,379 % fällig am 25.12.2035 | | 3.500 | 3.510 | 0,01 |
| **Spirit Master Funding LLC** | | | | |
| 4,360 % fällig am 20.12.2047 | | 60.273 | 62.602 | 0,09 |
| **Springleaf Funding Trust** | | | | |
| 2,680 % fällig am 15.07.2030 | | 20.282 | 20.333 | 0,03 |
| **START Ireland** | | | | |
| 4,089 % fällig am 15.03.2044 | | 26.321 | 26.532 | 0,04 |
| **Starwood Waypoint Homes Trust** | | | | |
| 3,439 % fällig am 17.01.2035 | | 47.559 | 47.566 | 0,07 |
| 3,659 % fällig am 17.01.2035 | | 5.800 | 5.799 | 0,01 |
| 3,889 % fällig am 17.01.2035 | | 14.983 | 14.986 | 0,02 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.05.2036 | | 7.378 | 7.034 | 0,01 |
| 2,577 % fällig am 25.07.2036 | | 22.827 | 16.095 | 0,02 |
| 2,594 % fällig am 25.03.2036 | | 7.302 | 6.974 | 0,01 |
| 2,714 % fällig am 25.01.2036 | | 5.716 | 5.487 | 0,01 |
| 2,764 % fällig am 25.04.2036 | | 2.480 | 2.445 | 0,00 |
| 2,824 % fällig am 25.11.2035 | | 15.064 | 14.946 | 0,02 |
| 2,954 % fällig am 25.09.2034 | | 4.951 | 4.869 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 25.04.2033 | | 630 | 621 | 0,00 |
| 3,124 % fällig am 25.04.2035 | | 5.850 | 5.887 | 0,01 |
| 3,124 % fällig am 25.05.2035 | | 3.379 | 3.399 | 0,00 |
| 3,139 % fällig am 25.08.2035 | | 4.822 | 4.841 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.05.2035 | | 5.973 | 6.036 | 0,01 |
| 3,334 % fällig am 25.06.2035 | | 9.234 | 8.851 | 0,01 |
| 3,404 % fällig am 25.09.2034 | | 7.102 | 7.140 | 0,01 |
| 3,529 % fällig am 25.07.2033 | | 903 | 906 | 0,00 |
| 3,604 % fällig am 25.12.2034 | | 1.710 | 1.720 | 0,00 |
| 3,679 % fällig am 25.12.2034 | | 1.470 | 1.497 | 0,00 |
| 3,784 % fällig am 25.04.2033 | | 13 | 13 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 3,109 % fällig am 25.02.2035 | | 1.681 | 1.666 | 0,00 |
| 3,154 % fällig am 25.02.2035 | | 2.891 | 2.835 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,534 % fällig am 25.05.2036 | | 8.534 | 8.230 | 0,01 |
| 2,534 % fällig am 25.02.2037 | | 5.661 | 5.609 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.05.2036 | | 2.079 | 2.081 | 0,00 |
| 2,574 % fällig am 25.01.2037 | | 5.849 | 5.777 | 0,01 |
| 2,574 % fällig am 25.06.2037 | | 6.268 | 6.230 | 0,01 |
| 2,584 % fällig am 25.03.2036 | | 4.440 | 4.401 | 0,01 |
| 2,624 % fällig am 25.10.2037 | | 24.540 | 18.518 | 0,03 |
| 2,634 % fällig am 25.01.2037 | | 20.606 | 14.836 | 0,02 |
| 2,634 % fällig am 25.02.2037 | | 15.453 | 15.017 | 0,02 |
| 2,634 % fällig am 25.05.2047 | | 15.027 | 14.503 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.09.2036 | | 13.821 | 13.701 | 0,02 |
| 2,674 % fällig am 25.07.2036 | | 11.763 | 11.669 | 0,02 |
| 2,694 % fällig am 25.07.2036 ^ | | 12.188 | 9.244 | 0,01 |
| 2,714 % fällig am 25.12.2036 | | 23.854 | 12.109 | 0,02 |
| 2,714 % fällig am 25.02.2037 | | 10.000 | 9.106 | 0,01 |
| 2,714 % fällig am 25.08.2046 | | 8.046 | 7.463 | 0,01 |
| 2,724 % fällig am 25.05.2037 | | 535 | 534 | 0,00 |
| 2,904 % fällig am 25.11.2037 | | 31.565 | 22.177 | 0,03 |
| 3,079 % fällig am 25.11.2035 | | 11.861 | 11.914 | 0,02 |
| 3,304 % fällig am 25.08.2037 | | 3.833 | 3.862 | 0,01 |
| 3,439 % fällig am 25.07.2035 | | 3.941 | 3.899 | 0,01 |
| 4,429 % fällig am 25.07.2035 | | 1.430 | 1.448 | 0,00 |
| 4,504 % fällig am 25.11.2035 | | 129 | 134 | 0,00 |
| 4,804 % fällig am 25.08.2034 | | 165 | 162 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2031 | | 575 | 429 | 0,00 |
| **Student Loan Consolidation Center Student Loan Trust** | | | | |
| 3,624 % fällig am 25.10.2027 | | 10.170 | 10.219 | 0,01 |
| **Symphony CLO Ltd.** | | | | |
| 3,477 % fällig am 15.04.2028 | | 15.500 | 15.426 | 0,02 |
| **Taberna Preferred Funding Ltd.** | | | | |
| 2,905 % fällig am 05.05.2038 | | 25.349 | 24.208 | 0,03 |
| 2,925 % fällig am 05.12.2036 | | 26.438 | 23.398 | 0,03 |
| 2,995 % fällig am 05.11.2035 | | 23.046 | 21.087 | 0,03 |
| 3,068 % fällig am 05.07.2035 | | 22.337 | 20.438 | 0,03 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.07.2037 | | 8.407 | 8.126 | 0,01 |
| 2,804 % fällig am 25.09.2036 | | 5.294 | 2.382 | 0,00 |
| 3,304 % fällig am 25.08.2036 | | 3.223 | 611 | 0,00 |
| **TICP CLO Ltd.** | | | | |
| 3,392 % fällig am 20.07.2027 | | 20.900 | 20.831 | 0,03 |
| 3,601 % fällig am 20.04.2028 | | 46.500 | 46.116 | 0,06 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,880 % fällig am 07.12.2029 | | | | |
| (c) | € | 24.000 | 27.331 | 0,04 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Tralee CLO Ltd.** | | | | |
| 3,622 % fällig am 20.10.2027 | $ | 4.200 | $ 4.200 | 0,01 |
| **Trapeza CDO Ltd.** | | | | |
| 2,759 % fällig am 10.10.2041 | | 10.043 | 9.440 | 0,01 |
| 2,842 % fällig am 09.11.2042 | | 1.046 | 973 | 0,00 |
| 2,879 % fällig am 06.04.2042 | | 11.779 | 10.896 | 0,02 |
| 2,929 % fällig am 06.07.2041 | | 14.554 | 13.681 | 0,02 |
| 2,989 % fällig am 06.07.2041 | | 9.000 | 7.470 | 0,01 |
| **Triaxx Prime CDO Ltd.** | | | | |
| 2,845 % fällig am 02.10.2039 | | 24.115 | 23.836 | 0,03 |
| **Tricon American Homes Trust** | | | | |
| 2,716 % fällig am 17.09.2034 | | 26.834 | 26.898 | 0,04 |
| **Tropic CDO Ltd.** | | | | |
| 2,917 % fällig am 15.07.2036 | | 16.756 | 15.081 | 0,02 |
| 3,247 % fällig am 15.07.2034 | | 115 | 109 | 0,00 |
| 3,347 % fällig am 15.04.2034 | | 1.072 | 1.018 | 0,00 |
| **Truman Capital Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.03.2036 | | 2.258 | 1.986 | 0,00 |
| **TruPS Financials Note Securitization Ltd.** | | | | |
| 2,861 % fällig am 20.09.2039 | | 15.952 | 15.513 | 0,02 |
| 3,489 % fällig am 30.03.2039 | | 40.576 | 39.764 | 0,05 |
| **Tymon Park CLO Ltd.** | | | | |
| 0,590 % fällig am 21.01.2029 | € | 5.500 | 6.252 | 0,01 |
| **Utah State Board of Regents** | | | | |
| 3,154 % fällig am 25.01.2057 | $ | 24.001 | 24.008 | 0,03 |
| 3,159 % fällig am 25.09.2056 | | 9.064 | 9.075 | 0,01 |
| **VCL Multi-Compartment S.A.** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.01.2025 | € | 61.746 | 70.546 | 0,10 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 3,417 % fällig am 15.04.2027 | $ | 55.683 | 55.601 | 0,08 |
| 3,447 % fällig am 15.01.2028 | | 32.350 | 32.262 | 0,04 |
| 3,477 % fällig am 15.04.2027 | | 39.475 | 39.379 | 0,05 |
| 3,477 % fällig am 15.07.2027 | | 64.940 | 65.009 | 0,09 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | | 63.787 | 64.094 | 0,09 |
| 3,375 % fällig am 25.10.2047 | | 7.164 | 7.204 | 0,01 |
| **Vertical Bridge CC LLC** | | | | |
| 5,193 % fällig am 15.10.2046 | | 3.301 | 3.399 | 0,00 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 25.07.2026 | | 24.799 | 24.779 | 0,03 |
| **WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust** | | | | |
| 2,534 % fällig am 25.07.2047 | | 7.277 | 5.078 | 0,01 |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | | 29.978 | 25.011 | 0,03 |
| 2,594 % fällig am 25.04.2037 | | 31.915 | 16.883 | 0,02 |
| 2,654 % fällig am 25.07.2047 | | 8.122 | 5.753 | 0,01 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,614 % fällig am 25.03.2037 | | 5.126 | 4.923 | 0,01 |
| 2,634 % fällig am 25.01.2037 | | 800 | 728 | 0,00 |
| 2,634 % fällig am 25.04.2037 | | 5.665 | 5.538 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.07.2036 | | 894 | 896 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.05.2036 | | 5.000 | 4.997 | 0,01 |
| 2,724 % fällig am 25.07.2036 | | 6.000 | 5.602 | 0,01 |
| 2,744 % fällig am 25.05.2036 | | 3.877 | 3.833 | 0,01 |
| 4,129 % fällig am 25.11.2035 | | 9.000 | 9.131 | 0,01 |
| 4,504 % fällig am 25.11.2035 | | 2.810 | 2.847 | 0,00 |
| 4,804 % fällig am 25.12.2034 | | 419 | 427 | 0,00 |
| 4,954 % fällig am 25.04.2035 | | 1.585 | 1.687 | 0,00 |
| 6,154 % fällig am 25.04.2035 | | 2.197 | 2.307 | 0,00 |
| **Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.04.2034 | | 613 | 618 | 0,00 |
| **WhiteHorse Ltd.** | | | | |
| 3,518 % fällig am 17.04.2027 | | 43.200 | 43.133 | 0,06 |
| 3,748 % fällig am 17.07.2026 | | 23.371 | 23.397 | 0,03 |
| | | | 12.419.710 | 16,96 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | € | 25.870 | 23.074 | 0,03 |
| 3,380 % fällig am 31.12.2038 | | 73.806 | 48.045 | 0,07 |
| 3,750 % fällig am 31.12.2038 | $ | 44.516 | 26.154 | 0,04 |
| 3,875 % fällig am 15.01.2022 | € | 78.805 | 73.687 | 0,10 |
| 4,625 % fällig am 11.01.2023 | $ | 27.028 | 21.690 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2027 | € | 700 | 585 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | | 9.300 | 7.741 | 0,01 |
| 5,625 % fällig am 26.01.2022 | $ | 12.380 | 10.461 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 11.01.2028 (m) | | 19.503 | 14.883 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 09.11.2047 | € | 3.800 | 3.149 | 0,00 |
| 6,625 % fällig am 06.07.2028 | $ | 5.700 | $ 4.415 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 26.01.2027 | | 23.300 | 18.748 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 11.01.2048 (m) | | 16.800 | 12.495 | 0,02 |
| 7,125 % fällig am 06.07.2036 | | 30.800 | 23.905 | 0,03 |
| 7,500 % fällig am 22.04.2026 | | 2.800 | 2.372 | 0,00 |
| 7,820 % fällig am 31.12.2033 | € | 97.673 | 92.921 | 0,13 |
| 40,244 % fällig am 04.10.2022 | ARS | 131.518 | 4.605 | 0,01 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | | 6.524.623 | 132.572 | 0,18 |
| 53,892 % fällig am 01.03.2020 (a) | | 271.624 | 6.177 | 0,01 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 22.299.044 | 513.536 | 0,70 |
| **Autonomous City of Buenos Aires Argentina** | | | | |
| 52,674 % fällig am 29.03.2024 (a) | | 389.635 | 7.527 | 0,01 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | € | 11.350 | 13.986 | 0,02 |
| 4,950 % fällig am 11.02.2020 | | 2.440 | 2.858 | 0,00 |
| 6,350 % fällig am 30.11.2041 | | 2.350 | 4.070 | 0,01 |
| **Corp. Financiera de Desarrollo S.A.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.07.2019 | $ | 2.800 | 2.801 | 0,00 |
| **Croatia Government International Bond** | | | | |
| 6,750 % fällig am 05.11.2019 | | 19.400 | 19.673 | 0,03 |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | | 11.000 | 11.097 | 0,02 |
| 3,125 % fällig am 11.10.2027 | | 107.400 | 111.615 | 0,15 |
| **Export-Credit Bank of Turkey** | | | | |
| 8,250 % fällig am 24.01.2024 | | 13.400 | 14.031 | 0,02 |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 2,750 % fällig am 12.08.2020 | | 3.800 | 3.809 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 02.10.2019 | | 1.600 | 1.605 | 0,00 |
| **Korea National Oil Corp.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 14.04.2021 | | 3.600 | 3.586 | 0,00 |
| **Kuwait International Government Bond** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.03.2022 | | 17.260 | 17.518 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2027 | | 79.000 | 84.227 | 0,11 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | PEN | 16.148 | 5.024 | 0,01 |
| 5,700 % fällig am 12.08.2024 | | 42.600 | 14.091 | 0,02 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 181.611 | 60.282 | 0,08 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 654.252 | 218.937 | 0,30 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 144.860 | 49.488 | 0,07 |
| 6,900 % fällig am 12.08.2037 | | 19.760 | 7.039 | 0,01 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 76.014 | 27.122 | 0,04 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 192.532 | 72.853 | 0,10 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** | | | | |
| 3,400 % fällig am 29.03.2021 | $ | 19.794 | 20.055 | 0,03 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 54,501 % fällig am 12.04.2025 (a) | ARS | 901.435 | 16.863 | 0,02 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 41.700 | 43.787 | 0,06 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 9.800 | 11.699 | 0,02 |
| **Republic of Greece Government International Bond** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.01.2023 | € | 4.304 | 5.320 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 30.01.2028 | | 4.618 | 5.848 | 0,01 |
| 3,900 % fällig am 30.01.2033 | | 9.948 | 12.721 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 30.01.2037 | | 6.211 | 8.007 | 0,01 |
| 4,200 % fällig am 30.01.2042 | | 3.488 | 4.552 | 0,01 |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 5,000 % fällig am 29.04.2020 | $ | 4.300 | 4.384 | 0,01 |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 26.10.2021 | | 26.500 | 26.488 | 0,04 |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 5.400 | 5.471 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 207.300 | 220.962 | 0,30 |
| 4,625 % fällig am 04.10.2047 | | 24.200 | 25.106 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 17.04.2049 | | 59.900 | 65.743 | 0,09 |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 4,875 % fällig am 25.02.2020 | | 9.445 | 9.576 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 28.09.2021 | | 9.533 | 10.459 | 0,01 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 4,625 % fällig am 31.03.2025 | € | 68.800 | 78.274 | 0,11 |
| 5,625 % fällig am 30.03.2021 | $ | 31.300 | 31.800 | 0,04 |
| 7,250 % fällig am 23.12.2023 | | 95.400 | 98.769 | 0,13 |
| 7,500 % fällig am 07.11.2019 | | 6.000 | 6.075 | 0,01 |
| 7,625 % fällig am 26.04.2029 | | 122.300 | 125.515 | 0,17 |
| **Venezuela Government International Bond** | | | | |
| 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^ | $ | 9.289 | $ 2.520 | 0,00 |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^ | | 14.228 | 3.770 | 0,01 |
| 7,650 % fällig am 21.04.2025 ^ | | 28.167 | 7.675 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 13.10.2019 ^ | | 5.850 | 1.558 | 0,00 |
| 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^ | | 35.331 | 9.716 | 0,01 |
| 9,000 % fällig am 07.05.2023 ^ | | 13.516 | 3.717 | 0,01 |
| 9,250 % fällig am 15.09.2027 ^ | | 34.519 | 10.097 | 0,01 |
| 9,250 % fällig am 07.05.2028 ^ | | 39.817 | 10.900 | 0,01 |
| 11,750 % fällig am 21.10.2026 ^ | | 3.990 | 1.157 | 0,00 |
| 12,750 % fällig am 23.08.2022 ^ | | 6.170 | 1.789 | 0,00 |
| | | | 2.684.827 | 3,67 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **AKTIEN** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (e) | 26.678.266 | 125.921 | 0,17 |
| iHeartMedia, Inc. (e) | 9.662.245 | 145.417 | 0,20 |
| iHeartMedia, Inc. 'A' (e) | 1.483.580 | 22.328 | 0,03 |
| iHeartMedia, Inc. 'B' (e) | 19.919 | 300 | 0,00 |
| | | 293.966 | 0,40 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Caesars Entertainment Corp. (e) | 9.573.895 | 113.163 | 0,16 |
| **ENERGIE** | | | |
| Dommo Energia S.A. (e)(l) | 2.151.637 | 1.530 | 0,00 |
| Dommo Energia S.A. SP - ADR (e) | 4.731 | 43 | 0,00 |
| Westmoreland Mining Holdings LLC (e)(l) | 82.937 | 1.203 | 0,00 |
| | | 2.776 | 0,00 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Eurobank Ergasias S.A. (e) | 40.899.918 | 40.317 | 0,06 |
| National Bank of Greece S.A. (e) | 632.515 | 1.735 | 0,00 |
| | | 42.052 | 0,06 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Sierra Hamilton Holder LLC (e)(l) | 2.210.032 | 628 | 0,00 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Eneva S.A. (e)(l) | 65.401 | 401 | 0,00 |
| | | 452.997 | 0,62 |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | |
| Sequa Corp. - Exp. 28.04.2024 | 87.344 | 205 | 0,00 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Nationwide Building Society 10,250 % | 818.696 | 157.726 | 0,22 |
| Sequa Corp. 9,000 % | 3.137 | 4.083 | 0,00 |
| | | 161.809 | 0,22 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (j) | 2.903.000 | $ 294.625 | 0,40 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | |
| VICI Properties, Inc. | 5.793.243 | 127.683 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | |
| Clear Channel Communication, Inc. | | | |
| 9,000 % fällig am 15.12.2019 | $ 183.808 | $ 0 | 0,00 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | |
| 0,960 % fällig am 28.02.2020 (f)(g) | ARS 427.846 | 9.925 | 0,02 |
| 3,860 % fällig am 31.07.2019 (f)(g) | 7.677 | 201 | 0,00 |
| | | 10.126 | 0,02 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 99.921 | 0,14 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (j) | 149.058.282 | $ 1.492.819 | 2,04 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 87.015.442** | **118,81** |

| | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (n)** | | | |
| | | 89.795 | 0,12 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 230 | $ (140) | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 2 | 6 | 0,00 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 2 | 13 | 0,00 |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 435 | (1.771) | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 1.911 | (3.170) | 0,00 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 14.380 | 36.486 | 0,05 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 12.569 | 80.663 | 0,11 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09/2019 | 26.007 | (33.778) | (0,05) |
| | | | | $ 78.309 | 0,11 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 78.309** | **0,11** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.12.2021 | $ 12.800 | $ (60) | 0,00 |
| Bombardier Inc. | 5,000 | 20.06.2024 | 4.100 | 164 | 0,00 |
| Deutsche Bank AG | 1,000 | 20.12.2019 | € 2.000 | 0 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2022 | $ 10.700 | (713) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2020 | 6.100 | 192 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 109.900 | 6.612 | 0,01 |
| Sprint Communications, Inc. | 5,000 | 20.12.2021 | 2.100 | (63) | 0,00 |
| | | | | $ 6.132 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-31 5-Year Index | (5,000) % | 20.12.2023 | $ 249.581 | $ (7.324) | (0,01) |
| CDX.HY-32 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2024 | 549.050 | (4.138) | (0,01) |
| CDX.IG-31 5-Year Index | (1,000) | 20.12.2023 | 62.700 | (393) | 0,00 |
| | | | | $ (11.855) | (0,02) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-24 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2020 | $ 10.580 | $ 404 | 0,00 |
| CDX.EM-28 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2022 | 226.582 | 6.050 | 0,01 |
| CDX.EM-29 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2023 | 128.840 | (170) | 0,00 |
| CDX.EM-30 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2023 | 906.100 | 16.464 | 0,02 |
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 602.800 | 2.120 | 0,00 |
| CDX.HY-24 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2020 | 548.803 | (26.126) | (0,03) |
| CDX.HY-25 5-Year Index | 5,000 | 20.12.2020 | 699.918 | (20.035) | (0,03) |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 555.900 | 2.260 | 0,00 |
| | | | | $ (19.033) | (0,03) |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 3,400 % | 20.06.2029 | CAD | 6.300 | $ 128 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month CAD-Bank Bill | 3,500 | 20.06.2044 | | 4.000 | (289) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 07.12.2022 | $ | 82.100 | 820 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,360 | 22.02.2023 | | 1.160.000 | 34.564 | 0,05 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | | 1.500.600 | (121.796) | (0,17) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | | 49.700 | (3.879) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2023 | | 2.048.200 | 119.057 | 0,16 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | | 66.800 | (233) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2026 | | 3.819.390 | (168.216) | (0,23) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | | 1.704.720 | (35.870) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | | 579.500 | (101.116) | (0,14) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,750 | 19.09.2028 | ZAR | 1.510.200 | 1.001 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,250 | 15.03.2024 | | 10.200 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,300 | 15.03.2027 | | 187.600 | 210 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 2,750 | 17.06.2026 | AUD | 72.880 | 5.172 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,000 | 21.03.2027 | | 1.178.940 | 83.943 | 0,12 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,000 | 21.03.2027 | | 100 | 8 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,250 | 17.12.2024 | | 197.200 | 9.094 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,500 | 17.06.2025 | | 361.600 | 17.266 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4,250 | 17.12.2024 | | 97.200 | 2.882 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4,750 | 18.06.2024 | | 124.400 | 1.916 | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | € | 907.700 | (49.757) | (0,07) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 19.06.2029 | | 244.000 | (22.611) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 2,000 | 17.09.2024 | | 149.000 | (4.423) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2029 | £ | 837.512 | (39.641) | (0,05) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,000 | 20.09.2026 | ¥ | 32.150.000 | (8.177) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 18.03.2026 | | 18.230.000 | (3.537) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 20.03.2028 | | 89.350.000 | (29.879 | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 21.03.2028 | | 26.590.000 | (9.539) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,301 | 13.02.2028 | | 10.140.000 | (3.415) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,351 | 08.02.2028 | | 7.300.000 | (2.308) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,354 | 18.01.2028 | | 25.650.000 | (8.307) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,354 | 16.02.2028 | | 12.850.000 | (4.095) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,372 | 22.10.2028 | | 20.000.000 | (5.854) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,380 | 18.06.2028 | | 17.780.000 | (6.180) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,399 | 18.06.2028 | | 4.540.000 | (1.573) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,400 | 27.03.2029 | | 12.800.000 | (4.642) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,415 | 25.03.2029 | | 5.890.000 | (2.139) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,446 | 18.06.2029 | | 12.360.000 | (5.213) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 20.03.2029 | | 918.577.000 | (331.535) | (0,45) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 29.03.2029 | | 12.820.000 | (4.676) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,471 | 18.06.2029 | | 12.360.000 | (5.229) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,095 | 05.02.2021 | MXN | 1.357.900 | 1.376 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,145 | 02.04.2020 | | 82.200 | 99 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,270 | 05.02.2020 | | 180.900 | 213 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,430 | 17.11.2021 | | 413.600 | 264 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,610 | 07.07.2021 | | 423.400 | 181 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,615 | 21.05.2021 | | 719.400 | 337 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,680 | 28.05.2021 | | 303.800 | 132 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,780 | 29.09.2022 | | 579.430 | 164 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,795 | 02.06.2023 | | 245.200 | 70 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,798 | 06.09.2021 | | 1.768.100 | 467 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,810 | 02.05.2022 | | 189.300 | 38 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,850 | 02.05.2022 | | 607.900 | 101 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,900 | 20.07.2021 | | 1.652.600 | 335 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,950 | 30.01.2026 | | 752.200 | 159 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,980 | 26.08.2024 | | 87.900 | 13 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,990 | 30.01.2026 | | 816.500 | 143 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,000 | 18.07.2022 | | 1.700.000 | 188 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,080 | 10.03.2026 | | 1.660.900 | 46 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,350 | 01.09.2023 | | 351.400 | (64) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,490 | 08.09.2026 | | 1.322.100 | (426) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,620 | 18.02.2030 | | 94.500 | (70) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,710 | 20.09.2029 | | 87.500 | (72) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,750 | 31.08.2021 | | 714.400 | (465) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,150 | 11.06.2027 | | 2.193.600 | (1.334) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,165 | 06.09.2032 | | 266.600 | (689) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,199 | 03.12.2021 | | 194.600 | (204) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,200 | 11.06.2027 | | 1.587.300 | (2.009) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,350 | 17.11.2021 | | 198.300 | (242) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,360 | 21.08.2037 | | 285.500 | (231) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,370 | 11.10.2027 | | 1.861.100 | (526) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,380 | 04.11.2026 | | 36.300 | (41) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,380 | 14.08.2037 | | 111.200 | (159) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,388 | 17.11.2021 | | 154.800 | (195) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,480 | 18.06.2037 | | 337.300 | (657) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,498 | 19.06.2037 | | 810.000 | (1.526) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,520 | 18.04.2023 | | 1.819.700 | 769 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,530 | 18.04.2023 | | 2.360.500 | 1.040 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,530 | 21.04.2023 | | 257.700 | 114 | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | | Nenn-betrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,538 % | 23.02.2022 | MXN | 698.000 | $ (953) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,545 | 18.04.2023 | | 2.167.800 | 998 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,603 | 14.04.2025 | | 1.995.300 | 1.464 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,610 | 23.01.2023 | | 4.957.600 | 3.899 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,610 | 15.04.2025 | | 288.800 | 210 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,640 | 03.01.2023 | | 214.500 | 124 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,645 | 03.01.2023 | | 466.500 | 274 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,670 | 05.03.2025 | | 5.616.000 | 5.063 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,700 | 02.05.2023 | | 713.700 | 681 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,710 | 26.02.2025 | | 1.873.400 | 1.654 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,710 | 07.03.2025 | | 347.300 | 335 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,715 | 07.03.2025 | | 345.200 | 337 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,745 | 05.01.2023 | | 313.500 | 237 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,800 | 28.12.2027 | | 273.800 | (306) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,805 | 06.02.2023 | | 760.000 | 651 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,818 | 17.02.2027 | | 816.800 | (1.259) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,820 | 06.02.2023 | | 870.300 | 946 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,865 | 27.12.2022 | | 536.600 | 502 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,865 | 02.02.2027 | | 1.026.600 | (1.636) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,875 | 16.12.2022 | | 306.800 | 286 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,880 | 27.12.2022 | | 7.579.800 | 3.793 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,910 | 30.12.2027 | | 967.500 | 2.197 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,984 | 10.12.2027 | | 32.700 | (56) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,990 | 21.12.2027 | | 14.700 | (26) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,005 | 21.12.2027 | | 3.730.800 | (4.638) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,010 | 04.02.2027 | | 448.800 | (771) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,030 | 31.01.2028 | | 450.400 | (852) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,050 | 31.01.2028 | | 679.600 | 1.376 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,090 | 15.01.2027 | | 1.435.600 | (2.551) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,103 | 04.01.2038 | | 3.750.800 | (8.499) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,120 | 15.01.2027 | | 293.600 | (529) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,280 | 28.11.2036 | | 690.000 | (1.881) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,310 | 28.11.2036 | | 1.066.400 | (3.018 | 0,00 |
| | | | | | | $ (712.681) | (0,97) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ (737.437)** | **(1,01)** |

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

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

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

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 111.700 | $ (106) | $ (9) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 89.200 | (107) | (16) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 | 21.08.2019 | 446.800 | (384) | (103) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 107.400 | (97) | (14) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 464.800 | (568) | (117) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 262.500 | (448) | (58) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 31.500 | (35) | (4) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 99,000 | 16.10.2019 | 194.900 | (721) | (354) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 97,000 | 20.11.2019 | 194.900 | (780) | (418) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 147.600 | (166) | (18) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 72.500 | (108) | (21) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 93,000 | 16.10.2019 | 409.600 | (655) | (135) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 94,000 | 16.10.2019 | 307.100 | (537) | (146) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 | 21.08.2019 | 748.700 | (722) | (173) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 236.300 | (239) | (36) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 77.400 | (122) | (20) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 89.700 | (99) | (27) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 101.200 | (152) | (25) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 105.100 | (123) | (19) | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 % | 18.09.2019 | 44.800 | $ (49) | $ (10) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 311.900 | (314) | (58) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 275.000 | (324) | (83) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 2,900 | 17.06.2020 | 616.300 | (555) | (149) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 316.600 | (502) | (93) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 3,000 | 17.06.2020 | 652.500 | (661) | (149) | 0,00 |
| JLN | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 85.300 | (136) | (25) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 75.900 | (129) | (19) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 89.600 | (90) | (17) | 0,00 |
| | | | | | | $ (8.929) | $ (2.316) | 0,00 |

**OPTIONEN AUF WERTPAPIERE**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FAR | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 08.01.2049 | $ 99,188 | 06.08.2019 | 86.000 | $ (212) | $ (58) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 08.01.2049 | 101,188 | 06.08.2019 | 86.000 | (161) | (242) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 09.01.2049 | 98,625 | 05.09.2019 | 433.600 | (881) | (428) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 09.01.2049 | 99,336 | 05.09.2019 | 139.800 | (404) | (265) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 09.01.2049 | 101,336 | 05.09.2019 | 139.800 | (328) | (454) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 09.01.2049 | 101,625 | 05.09.2019 | 433.600 | (677) | (1.008) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC Fannie Mae 3,500 % fällig am 07.01.2049 | 99,438 | 08.07.2019 | 496.000 | (620) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae 3,500 % fällig am 07.01.2049 | 101,438 | 08.07.2019 | 496.000 | (504) | (4.082) | (0,01) |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 08.01.2049 | 99,141 | 06.08.2019 | 86.000 | (212) | (54) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 08.01.2049 | 101,141 | 06.08.2019 | 86.000 | (161) | (257) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 09.01.2049 | 98,625 | 05.09.2019 | 433.600 | (881) | (428) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 09.01.2049 | 101,625 | 05.09.2019 | 433.600 | (677) | (1.008) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 08.01.2049 | 101,035 | 06.08.2019 | 101.700 | (246) | (42) | 0,00 |
| | | | | | $ (5.964) | $ (8.326) | (0,01) |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | UBS AG | (1,000) % | 20.06.2024 | $ 19.300 | $ 1.254 | $ (1.571) | $ (317) | 0,00 |
| BPS | UBS AG | (1,000) | 20.06.2024 | 7.000 | 458 | (573) | (115) | 0,00 |
| | | | | | $ 1.712 | $ (2.144) | $ (432) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2022 | $ 22.300 | $ (732) | $ 666 | $ (66) | 0,00 |
| | Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 | 20.06.2020 | 100 | (15) | 15 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 500 | (14) | 14 | 0 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 2.220 | (177) | 191 | 14 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 2.400 | (93) | 109 | 16 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 4.600 | (119) | 110 | (9) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 6.800 | (648) | 606 | (42) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2024 | 2.700 | (274) | 249 | (25) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 6.300 | (316) | 225 | (91) | 0,00 |
| BPS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 22.900 | (1.062) | 1.082 | 20 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 74.900 | (1.553) | 1.570 | 17 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 35.400 | (572) | 400 | (172) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2019 | 6.950 | (675) | 702 | 27 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.03.2020 | 1.300 | (216) | 223 | 7 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2021 | 1.000 | (280) | 287 | 7 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2021 | 400 | (61) | 62 | 1 | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.06.2022 | 31.500 | (1.413) | (274) | (1.687) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 7.700 | (1.258) | 284 | (974) | 0,00 |
| BRC | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.12.2022 | 13.900 | 1.569 | (3.513) | (1.944) | 0,00 |
| | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2023 | 21.900 | 273 | (3.466) | (3.193) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 57.900 | (2.291) | 2.119 | (172) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 8.750 | (538) | 479 | (59) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 675 | 2 | 3 | 5 | 0,00 |
| | Panama Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 4.500 | 29 | 68 | 97 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2019 | 19.400 | (2.492) | 2.567 | 75 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2021 | 5.800 | (1.670) | 1.713 | 43 | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.12.2021 | 3.000 | (272) | 146 | (126) | 0,00 |
| | Qatar Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 47.000 | 237 | 714 | 951 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 10.400 | (839) | 903 | 64 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 74.450 | (2.101) | 2.609 | 508 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 22.400 | (429) | 526 | 97 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 6.300 | (742) | 703 | (39) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2024 | 4.100 | (414) | 376 | (38) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 20.400 | (1.297) | 1.356 | 59 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 4.100 | (289) | 288 | (1) | 0,00 |

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2023 | $ 1.200 | $ (73) | $ 56 | $ (17) | 0,00 |
| CBK | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2022 | 18.000 | 1.153 | (3.555) | (2.402) | 0,00 |
| | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.12.2022 | 10.500 | 1.081 | (2.549) | (1.468) | 0,00 |
| | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2023 | 23.782 | 638 | (4.105) | (3.467) | (0,01) |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 50.505 | (1.969) | 1.819 | (150) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 155.300 | (5.144) | 1.607 | (3.537) | (0,01) |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 42.200 | (430) | 619 | 189 | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 75.800 | (1.119) | 1.718 | 599 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 121.200 | (2.101) | 1.513 | (588) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2019 | 1.500 | (164) | 170 | 6 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 14.080 | (1.101) | 1.188 | 87 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 5.700 | (618) | 583 | (35) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2024 | 6.400 | (555) | 496 | (59) | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 22.500 | 52 | 276 | 328 | 0,00 |
| | Shire Acquisitions Investments Ireland DAC | 1,000 | 20.12.2021 | € 5.600 | (209) | 233 | 24 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | $ 2.800 | (141) | 101 | (40) | 0,00 |
| DUB | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.12.2022 | 21.600 | 2.321 | (5.341) | (3.020) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 80.000 | (2.892) | 2.654 | (238) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 9.600 | 30 | 104 | 134 | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 22.500 | 208 | 308 | 516 | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.12.2021 | 900 | (85) | 47 | (38) | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.06.2022 | 13.500 | (624) | (99) | (723) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 5.200 | (361) | 359 | (2) | 0,00 |
| FBF | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.12.2022 | 2.650 | 308 | (679) | (371) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 7.000 | (270) | 249 | (21) | 0,00 |
| | Panama Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 5.000 | 30 | 77 | 107 | 0,00 |
| GST | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2022 | 18.000 | 1.153 | (3.555) | (2.402) | 0,00 |
| | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.12.2022 | 24.800 | 2.795 | (6.263) | (3.468) | (0,01) |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 6.300 | (258) | 239 | (19) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 230.800 | (7.522) | 2.265 | (5.257) | (0,01) |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 53.900 | (807) | 1.277 | 470 | 0,00 |
| | Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. | 1,000 | 20.06.2020 | 600 | (91) | 94 | 3 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 77.850 | (714) | 1.136 | 422 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 55.900 | (1.162) | 1.174 | 12 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2019 | 4.850 | (521) | 540 | 19 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.03.2020 | 200 | (30) | 31 | 1 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.09.2020 | 1.980 | (288) | 301 | 13 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2021 | 10.013 | (2.794) | 2.869 | 75 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2021 | 7.300 | (1.251) | 1.278 | 27 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2022 | 16.500 | (1.498) | 1.497 | (1) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2022 | 7.800 | (443) | 383 | (60) | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.12.2021 | 500 | (46) | 25 | (21) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.03.2020 | 500 | (93) | 95 | 2 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 500 | (68 | 70 | 2 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 2.700 | (205) | 222 | 17 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 387.450 | (8.475) | 10.151 | 1.676 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 156.800 | (2.532) | 2.226 | (306) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.500 | (170) | 161 | (9) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 4.200 | (268) | 280 | 12 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 19.700 | (1.379) | 1.372 | (7) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 8.700 | (449) | 251 | (198) | 0,00 |
| HUS | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2023 | 16.400 | 241 | (2.632) | (2.391) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.09.2019 | 207.300 | 329 | 14 | 343 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 30.100 | (953) | 506 | (447) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 255.100 | (7.463) | 1.652 | (5.811) | (0,01) |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 1.500 | 7 | 14 | 21 | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 32.400 | (94) | 239 | 145 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 296.450 | (4.732) | 4.798 | 66 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 388.100 | (6.241) | 4.358 | (1.883) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2019 | 14.060 | (1.411) | 1.465 | 54 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.03.2020 | 2.600 | (444) | 457 | 13 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.09.2020 | 1.120 | (159) | 166 | 7 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2021 | 1.100 | (315) | 323 | 8 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2022 | 10.000 | (568) | 491 | (77) | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.12.2021 | 2.000 | (183) | 99 | (84) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 10.120 | (782) | 844 | 62 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 26.900 | (122) | 238 | 116 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 3.640 | (375) | 353 | (22) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2024 | 2.459 | (336) | 313 | (23) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 8.300 | (514) | 538 | 24 | 0,00 |
| JPM | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2023 | 3.000 | 21 | (458) | (437) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 90.700 | (1.766) | 1.786 | 20 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 11.800 | (191) | 134 | (57) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2019 | 2.940 | (272) | 283 | 11 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2021 | 2.300 | (373) | 381 | 8 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2022 | 9.000 | (703) | 702 | (1) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 2.000 | (222) | 233 | 11 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 12.300 | (976) | 1.052 | 76 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 7.800 | (304) | 357 | 53 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 14.400 | (434) | 468 | 34 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.700 | (156) | 146 | (10) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 4.800 | (339) | 337 | (2) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 48.200 | (2.857) | 2.163 | (694) | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | South Africa Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 37.600 | $ (2.111) | $ 1.256 | $ (855) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 4.400 | (764) | 208 | (556) | 0,00 |
| MYC | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2022 | 4.500 | 296 | (897) | (601) | 0,00 |
| | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.12.2022 | 32.300 | 3.653 | (8.169) | (4.516) | (0,01) |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 19.000 | (704) | 647 | (57) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 7.100 | (84) | 189 | 105 | 0,00 |
| | Panama Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 4.500 | 19 | 78 | 97 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2019 | 10.700 | (990) | 1.031 | 41 | 0,00 |
| | Qatar Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 7.000 | 33 | 109 | 142 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 1.200 | (149) | 156 | 7 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 54.900 | (1.097) | 1.226 | 129 | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 67.700 | 156 | 832 | 988 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 2.100 | (148) | 147 | (1) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 29.900 | (627) | 357 | (270) | 0,00 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 106.400 | (17.076) | 3.622 | (13.454) | (0,02) |
| NGF | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 30.100 | (299) | 306 | 7 | 0,00 |
| | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 32.200 | 78 | 392 | 470 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2021 | 1.400 | (86) | 90 | 4 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 10.100 | (724) | 721 | (3) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 10.200 | (531) | 299 | (232) | 0,00 |
| UAG | Avolon Holdings Ltd. | 5,000 | 01.07.2020 | 11.600 | 679 | (198) | 481 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 200 | (15) | 15 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ (113.071) | $ 54.317 | $ (58.754 | (0,08) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | ABX.HE.AA.6-1 Index | 0,320 % | 25.07.2045 | $ 1.858 | $ (641) | $ 539 | $ (102) | 0,00 |
| | ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25.05.2046 | 70.073 | (15.104) | 10.030 | (5.074) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 15.891 | (364) | 502 | 138 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AS.6 Index | 1,000 | 11.05.2063 | 2.000 | (5) | 36 | 31 | 0,00 |
| BRC | ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25.05.2046 | 6.308 | (1.358) | 901 | (457) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 11.966 | (425) | 529 | 104 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AS.6 Index | 1,000 | 11.05.2063 | 13.800 | (464) | 676 | 212 | 0,00 |
| | PRIMEX.ARM.2-AAA Index | 4,580 | 25.12.2037 | 515 | 22 | (16) | 6 | 0,00 |
| CBK | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 23.932 | (859) | 1.067 | 208 | 0,00 |
| DUB | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 233.645 | (4.705) | 6.579 | 1.874 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 645.100 | (3.371) | 5.943 | 2.572 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 39.249 | (1.253) | 1.594 | 341 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 | 17.01.2047 | 6.769 | (210) | 284 | 74 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 6.800 | (304) | 383 | 79 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 88.800 | (1.103) | 2.014 | 911 | 0,00 |
| FBF | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 688.600 | (4.427) | 7.173 | 2.746 | 0,01 |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 752.300 | (5.256) | 4.132 | (1.124) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 89.507 | (2.971) | 3.749 | 778 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 | 17.01.2047 | 81.929 | (2.830) | 3.720 | 890 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 8.600 | (467) | 567 | 100 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 271.500 | (12.648) | 15.432 | 2.784 | 0,01 |
| GST | ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25.05.2046 | 1.713 | (345) | 221 | (124) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 1.213.550 | (16.459) | 26.193 | 9.734 | 0,01 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 216.000 | (1.013) | 1.874 | 861 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 203.378 | 1.286 | 482 | 1.768 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 | 17.01.2047 | 4.181 | (200) | 245 | 45 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 17.250 | (904) | 1.105 | 201 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 370.575 | (11.177) | 14.977 | 3.800 | 0,01 |
| JPS | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 171.400 | (2.957) | 4.332 | 1.375 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 171.700 | (1.351) | 2.036 | 685 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 19.300 | (858) | 1.083 | 225 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 59.800 | (2.768) | 3.381 | 613 | 0,00 |
| MEI | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 45.500 | (336) | 268 | (68) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 9.860 | (90) | 176 | 86 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 22.700 | (1.248) | 1.512 | 264 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 25.000 | (1.348) | 1.604 | 256 | 0,00 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 66.700 | (1.419) | 1.954 | 535 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 364.800 | (3.092) | 4.547 | 1.455 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 120.500 | (900) | 720 | (180) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 26.326 | (956) | 1.185 | 229 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 | 17.01.2047 | 6.769 | (210) | 284 | 74 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 212.700 | (11.339) | 13.520 | 2.181 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AS.6 Index | 1,000 | 11.05.2063 | 1.200 | (37) | 55 | 18 | 0,00 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 810.495 | (7.907) | 14.408 | 6.501 | 0,01 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 152.400 | (785) | 1.393 | 608 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 379.800 | (2.691) | 2.123 | (568) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 312.462 | 2.005 | 711 | 2.716 | 0,01 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 8.600 | (471) | 571 | 100 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 673.100 | (849) | 7.751 | 6.902 | 0,01 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 15.500 | (445) | 569 | 124 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 26.326 | (931) | 1.160 | 229 | 0,00 |
| | | | | | $ (128.538) | $ 176.274 | $ 47.736 | 0,06 |

(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 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.

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,250 % | 06.09.2019 | MXN 165.000 | $ (23) | $ (43) | $ (66) | 0,00 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | $ 12.400 | 20.09.2019 | $ (87) | $ 554 | $ 467 | 0,00 |
| CBK | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 14.000 | 20.09.2019 | (24) | 1.078 | 1.054 | 0,00 |
| FBF | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 5.200 | 20.09.2019 | (8) | 419 | 411 | 0,00 |
| GST | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 6.800 | 20.09.2019 | (3) | 31 | 28 | 0,00 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 28.400 | 20.09.2019 | (196) | 1.328 | 1.132 | 0,00 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 20.500 | 20.12.2019 | (8) | 86 | 78 | 0,00 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 75.000 | 20.12.2019 | (461) | 1.390 | 929 | 0,00 |
| JPM | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 137.400 | 20.09.2019 | (822) | 6.933 | 6.111 | 0,01 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 43.100 | 20.09.2019 | (251) | 1.223 | 972 | 0,00 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 11.900 | 20.12.2019 | (72) | 253 | 181 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (1.932) | $ 13.295 | $ 11.363 | 0,01 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 11.663 | $ | 13.166 | $ 0 | $ (116) | (116) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 6.576 | | 8.242 | 0 | (127) | (127) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 389.043 | AUD | 557.149 | 1.936 | 0 | 1.936 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 112.190 | CAD | 147.563 | 734 | 0 | 734 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 6.973 | € | 6.150 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 6.816 | £ | 5.364 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.407 | ¥ | 152.500 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 13.835 | RUB | 900.000 | 407 | 0 | 407 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 553.473 | $ | 386.921 | 0 | (1.905) | (1.905) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 147.563 | | 112.271 | 0 | (736) | (736) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 2.137 | SGD | 2.926 | 28 | 0 | 28 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 17.316 | DKK | 112.746 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | ARS | 2.097.908 | $ | 41.720 | 0 | (5.867) | (5.867) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 12.612 | | 14.145 | 0 | (217) | (217) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 10.991 | | 13.834 | 0 | (154) | (154) | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 78.132 | | 13.506 | 7 | (2) | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 43.588 | ARS | 2.185.795 | 6.137 | 0 | 6.137 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 7.814 | AUD | 11.288 | 108 | 0 | 108 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 7.418 | € | 6.506 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 17.359 | £ | 13.631 | 12 | (23) | (11) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 451.353 | ¥ | 48.673.882 | 419 | 0 | 419 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 89.293 | TRY | 525.964 | 1.141 | (5) | 1.136 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 48.673.882 | $ | 452.428 | 0 | (429) | (429) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 345.789 | MXN | 6.899.478 | 10.837 | 0 | 10.837 | 0,02 |
| | 09/2019 | ARS | 4.261.661 | $ | 88.941 | 527 | (34) | 493 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 2.595 | | 374 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 6.899.478 | | 342.060 | 0 | (10.863) | (10.863) | (0,01) |
| | 03/2020 | ARS | 84.861 | | 1.566 | 112 | 0 | 112 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | $ | 46.797 | £ | 36.768 | 62 | (64) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 661 | ZAR | 9.622 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.531 | RUB | 100.000 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | 12/2019 | | 24.750 | ARS | 1.482.508 | 3.035 | 0 | 3.035 | 0,00 |
| | 03/2020 | ARS | 158.407 | $ | 2.932 | 219 | 0 | 219 | 0,00 |
| BSS | 07/2019 | $ | 4.377 | ARS | 229.553 | 960 | 0 | 960 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.510 | | 81.139 | 228 | 0 | 228 | 0,00 |
| | 08/2021 | CLP | 4.120.528 | $ | 6.084 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | € | 35.090 | | 39.884 | 0 | (76) | (76) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 14.696 | | 18.608 | 0 | (96) | (96) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | PEN | 174.586 | $ | 52.564 | $ 0 | $ (506) | $ (506) | 0,00 |
| | 07/2019 | SGD | 7.863 | | 5.808 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 847.189 | AUD | 1.211.396 | 2.908 | 0 | 2.908 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 116.486 | £ | 91.883 | 453 | 0 | 453 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5.856 | ¥ | 633.500 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 52.971 | PEN | 174.586 | 100 | 0 | 100 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 145.790 | RUB | 9.644.268 | 6.827 | 0 | 6.827 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.584 | ZAR | 23.150 | 56 | 0 | 56 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 1.197.544 | $ | 838.494 | 0 | (2.804) | (2.804) | 0,00 |
| | 08/2019 | PEN | 33.850 | | 10.062 | 0 | (216) | (216) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 10.407 | MXN | 201.102 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 09/2019 | ARS | 17.505 | $ | 376 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | PEN | 183.584 | | 55.502 | 0 | (143) | (143) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 364.595 | | 107.414 | 0 | (2.962) | (2.962) | 0,00 |
| DUB | 07/2019 | ARS | 950.105 | | 19.175 | 0 | (2.339) | (2.339) | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 5.011 | | 723 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 254.316 | INR | 18.048.179 | 4.569 | 0 | 4.569 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | € | 3.028.791 | $ | 3.386.410 | 0 | (62.778) | (62.778) | (0,09) |
| | 07/2019 | £ | 48.780 | | 61.999 | 7 | (91) | (84) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 22.530 | ARS | 1.114.090 | 2.697 | 0 | 2.697 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 59.033 | € | 52.161 | 368 | 0 | 368 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 97.177 | TRY | 572.727 | 1.300 | 0 | 1.300 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 153.138 | RUB | 10.000.000 | 4.405 | 0 | 4.405 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 3.417 | SEK | 32.712 | 120 | 0 | 120 | 0,00 |
| | 09/2019 | ARS | 17.505 | $ | 380 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 1.428 | | 182 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 225.221 | RUB | 14.847.637 | 7.651 | 0 | 7.651 | 0,01 |
| | 10/2019 | | 96.181 | MXN | 1.878.988 | 0 | (66) | (66) | 0,00 |
| | 12/2019 | ARS | 4.609.942 | $ | 82.687 | 997 | (4.707) | (3.710) | (0,01) |
| | 03/2020 | $ | 15.458 | ARS | 848.622 | 0 | (924) | (924) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | ARS | 3.247.651 | $ | 65.444 | 0 | (7.989) | (7.989) | (0,01) |
| | 07/2019 | AUD | 2.761 | | 1.931 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 149.717 | | 111.065 | 0 | (3.507) | (3.507) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF | 2.660 | | 2.726 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | CNH | 3.465 | | 503 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 15.571 | | 17.719 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 16.351 | | 20.842 | 47 | (15) | 32 | 0,00 |
| | 07/2019 | HKD | 40.805 | | 5.226 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 599.087 | | 391.030 | 0 | (11.347) | (11.347) | (0,02) |
| | 07/2019 | SGD | 18.275 | | 13.506 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 45.457 | ARS | 2.258.046 | 5.643 | 0 | 5.643 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 248 | AUD | 354 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 9.294 | € | 8.174 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| | 08/2019 | PEN | 6.744 | $ | 2.019 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 42.137 | ¥ | 4.520.300 | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| | 08/2019 | | 10.314 | MXN | 198.457 | 0 | (56) | (56) | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 1.000 | $ | 128 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 82.937 | ARS | 4.250.543 | 5.273 | 0 | 5.273 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 1.741 | CNH | 12.066 | 14 | 0 | 14 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 14.433 | HKD | 112.969 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 55.678 | RUB | 3.640.248 | 1.416 | 0 | 1.416 | 0,00 |
| | 12/2019 | | 51.876 | ARS | 3.127.434 | 6.737 | 0 | 6.737 | 0,01 |
| | 02/2020 | ARS | 396.171 | $ | 7.412 | 544 | 0 | 544 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | € | 1.760.340 | | 1.969.017 | 0 | (35.659) | (35.659) | (0,05) |
| | 07/2019 | £ | 2.008 | | 2.529 | 0 | (27) | (27) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 116.837.481 | | 1.071.960 | 0 | (12.480) | (12.480) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 7.094 | AUD | 10.246 | 96 | 0 | 96 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 17.223 | DKK | 112.746 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 18.151 | € | 16.050 | 126 | 0 | 126 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 45.060 | £ | 35.503 | 125 | 0 | 125 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.062 | ZAR | 59.053 | 122 | 0 | 122 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 613 | MXN | 11.845 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | ARS | 17.505 | $ | 375 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 255.640 | MXN | 4.993.679 | 91 | 0 | 91 | 0,00 |
| | 02/2020 | ARS | 103.341 | $ | 1.928 | 137 | 0 | 137 | 0,00 |
| | 02/2020 | $ | 9.011 | ARS | 499.512 | 0 | (352) | (352) | 0,00 |
| | 03/2020 | ARS | 585.554 | $ | 10.864 | 835 | 0 | 835 | 0,00 |
| | 06/2020 | $ | 1.334 | ARS | 76.638 | 0 | (134) | (134) | 0,00 |
| MSB | 09/2019 | ARS | 17.505 | $ | 376 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 127.429 | RUB | 8.432.080 | 4.821 | 0 | 4.821 | 0,01 |
| | 03/2020 | ARS | 19.801 | $ | 366 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| | 06/2020 | | 76.638 | | 1.381 | 181 | 0 | 181 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | AUD | 213 | | 149 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 166 | | 189 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 11.177 | | 14.144 | 0 | (82) | (82) | 0,00 |
| | 07/2019 | HKD | 51.727 | | 6.622 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 236.447 | | 154.319 | 0 | (4.491) | (4.491) | (0,01) |
| RBC | 07/2019 | $ | 771.496 | ¥ | 83.178.599 | 535 | 0 | 535 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 83.178.599 | $ | 773.341 | 0 | (544) | (544) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | AUD | 1.798.702 | | 1.247.188 | 0 | (15.051) | (15.051) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 274.425 | NZD | 410.265 | 1.130 | 0 | 1.130 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 17.356 | TRY | 103.062 | 453 | 0 | 453 | 0,00 |
| | 08/2019 | NZD | 410.265 | $ | 274.610 | 0 | (1.142) | (1.142) | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | $ | 37.836 | RUB | 2.497.553 | $ 1.511 | $ 0 | $ 1.511 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 1.994 | $ | 288 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR | 15.205.672 | | 1.038 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | $ | 77.826 | RUB | 5.097.304 | 2.837 | 0 | 2.837 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 298.095 | | 19.598.540 | 10.668 | 0 | 10.668 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 285.619 | | 18.855.804 | 10.119 | 0 | 10.119 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | £ | 3.717.043 | $ | 4.696.658 | 0 | (34.023) | (34.023) | (0,05) |
| | 07/2019 | ¥ | 15.801.000 | | 146.314 | 0 | (344) | (344) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.067 | AUD | 1.534 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.616 | CAD | 2.154 | 32 | 0 | 32 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | £ | 4.116 | $ | 5.247 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 5.031 | AUD | 7.280 | 78 | 0 | 78 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.016 | MXN | 38.996 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | PEN | 65.535 | $ | 19.493 | 0 | (377) | (377) | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 256.207 | MXN | 5.020.490 | 602 | 0 | 602 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 1.012 | HKD | 7.908 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.849 | SGD | 2.503 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 33.376 | TRY | 196.940 | 487 | 0 | 487 | 0,00 |
| | 08/2019 | NZD | 120.953 | $ | 79.733 | 0 | (1.581) | (1.581) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 135.435 | RUB | 8.870.298 | 4.311 | 0 | 4.311 | 0,01 |
| | | | | | | $ 118.625 | $ (227.634) | $ (109.009) | (0,15) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 493.709 | $ | 344.781 | $ 0 | $ (1.679) | $ (1.679) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 16.083 | AUD | 23.340 | 295 | 0 | 295 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 345.142 | | 493.709 | 1.699 | 0 | 1.699 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 1.435 | | 2.047 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 495.425 | $ | 346.521 | 0 | (1.144) | (1.144) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 307.953 | AUD | 444.838 | 4.212 | 0 | 4.212 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 346.886 | | 495.425 | 1.160 | 0 | 1.160 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 4.468 | | 6.463 | 67 | 0 | 67 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | AUD | 4.731 | $ | 3.306 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 19.399 | AUD | 27.971 | 229 | 0 | 229 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | | 302.455 | | 436.036 | 3.533 | 0 | 3.533 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 32.774 | | 47.027 | 227 | 0 | 227 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 335.707 | | 484.026 | 3.958 | 0 | 3.958 | 0,01 |
| | | | | | | $ 15.382 | $ (2.837) | $ 12.545 | 0,02 |

Zum 30. Juni 2019 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | BRL | 16.364 | $ | 4.256 | $ 0 | $ (14) | $ (14) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.114 | BRL | 8.187 | 17 | 0 | 17 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 1.337 | | 5.140 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | BRL | 833.799 | $ | 218.186 | 635 | 0 | 635 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 177.283 | BRL | 714.396 | 9.115 | 0 | 9.115 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 217.537 | | 833.799 | 0 | (588) | (588) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | BRL | 833.799 | $ | 218.129 | 578 | 0 | 578 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 217.481 | BRL | 833.799 | 0 | (532) | (532) | 0,00 |
| IND | 07/2019 | BRL | 804.858 | $ | 210.420 | 420 | 0 | 420 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 203.546 | BRL | 825.074 | 11.728 | 0 | 11.728 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 209.792 | | 804.858 | 0 | (374) | (374) | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | | 71.430 | | 289.115 | 4.004 | 0 | 4.004 | 0,01 |
| SCX | 07/2019 | | 3.385 | | 13.643 | 175 | 0 | 175 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 158.954 | | 641.453 | 8.411 | 0 | 8.411 | 0,01 |
| | | | | | | $ 35.086 | $ (1.508) | $ 33.578 | 0,04 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional CAD (Hedged) thesaurierend und Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CAD | 73.411 | $ | 55.813 | $ 0 | $ (365) | $ (365) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 53.136 | CAD | 71.827 | 1.831 | 0 | 1.831 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 55.853 | | 73.411 | 366 | 0 | 366 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 163 | | 220 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 73.307 | $ | 55.861 | 0 | (237) | (237) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 53.780 | CAD | 72.496 | 1.698 | 0 | 1.698 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 55.848 | | 73.238 | 238 | 0 | 238 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 07/2019 | CAD | 1.886 | $ | 1.434 | $ 0 | $ (9) | $ (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 54.770 | CAD | 73.811 | 1.715 | 0 | 1.715 | 0,00 |
| | | | | | | $ 5.853 | $ (611) | $ 5.242 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 195.773 | CHF | 196.358 | $ 5.620 | $ 0 | $ 5.620 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | CHF | 1.554 | $ | 1.559 | 0 | (35) | (35) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.754 | CHF | 1.736 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF | 197.410 | $ | 201.600 | 0 | (872) | (872) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 193.807 | CHF | 194.218 | 5.391 | 0 | 5.391 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 202.186 | | 197.410 | 880 | 0 | 880 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | CHF | 3.821 | $ | 3.922 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 196.854 | CHF | 198.114 | 6.340 | 0 | 6.340 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 204.482 | $ | 209.297 | 0 | (428) | (428) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 202.469 | CHF | 197.237 | 419 | 0 | 419 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 5.110 | | 5.051 | 71 | 0 | 71 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | CHF | 2.568 | $ | 2.580 | 0 | (54) | (54) | 0,00 |
| | | | | | | $ 18.750 | $ (1.389) | $ 17.361 | 0,02 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend II, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend A, Administrative EUR (Hedged) thesaurierend, Administrative EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend II, G Retail EUR (Hedged) ausschüttend, H Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Class R EUR (Hedged) ausschüttend, Class T EUR (Hedged) thesaurierend und Class T EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 950.985 | € | 851.092 | $ 18.239 | $ 0 | $ 18.239 | 0,02 |
| BPS | 07/2019 | € | 281.102 | $ | 319.723 | 79 | (476) | (397) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 334.394 | € | 297.285 | 4.155 | 0 | 4.155 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | | 754.535 | | 665.803 | 3.941 | (259) | 3.682 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | | 9.884.273 | | 8.844.637 | 188.003 | 0 | 188.003 | 0,26 |
| HUS | 07/2019 | | 9.434.787 | | 8.439.968 | 176.652 | 0 | 176.652 | 0,24 |
| JPM | 07/2019 | | 8.330.206 | | 7.448.713 | 152.392 | 0 | 152.392 | 0,21 |
| RBC | 07/2019 | | 149.134 | | 131.483 | 599 | 0 | 599 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | | 309.905 | | 273.987 | 2.111 | 0 | 2.111 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 54.414 | $ | 61.280 | 0 | (686) | (686) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 167(666 | € | 148.700 | 1.674 | 0 | 1.674 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 89.597 | | 79.235 | 636 | 0 | 636 | 0,00 |
| | | | | | | $ 548.481 | $ (1.421) | $ 547.060 | 0,75 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend, Administrative GBP (Hedged) ausschüttend, Class E GBP (Hedged) ausschüttend und Class R GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | £ | 2.750 | $ | 3.471 | $ 0 | $ (30) | $ (30) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 5.398 | £ | 4.290 | 62 | 0 | 62 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 289.940 | $ | 367.745 | 0 | (1.261) | (1.261) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 19.941 | £ | 15.727 | 75 | 0 | 75 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 364.546 | | 286.977 | 1.258 | 0 | 1.258 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | £ | 288.130 | $ | 366.097 | 0 | (606) | (606) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 351.677 | £ | 277.544 | 1.558 | (5) | 1.553 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 366.658 | | 288.130 | 615 | 0 | 615 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 3.614 | | 2.854 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | £ | 10.553 | $ | 13.472 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.695 | £ | 1.339 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 2.147 | | 1.684 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 348.796 | | 275.576 | 1.930 | 0 | 1.930 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 363.471 | | 287.552 | 2.506 | (9) | 2.497 | 0,01 |
| | | | | | | $ 8.072 | $ (1.915) | $ 6.157 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional JPY (Hedged) thesaurierend und Class E JPY (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | 07/2019 | $ | 6.267 | ¥ | 686.341 | $ 103 | $ 0 | $ 103 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | ¥ | 14.984 | $ | 140 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.272 | ¥ | 683.340 | 70 | 0 | 70 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 6.191 | | 677.587 | 98 | 0 | 98 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| HUS | 07/2019 | ¥ | 697.283 | $ | 6.479 | $ 8 | $ 0 | $ 8 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 6.495 | ¥ | 697.283 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | ¥ | 697.283 | $ | 6.477 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 6.492 | ¥ | 697.283 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 46 | | 4.935 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 285 | $ (12) | $ 273 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 457 | NOK | 3.976 | $ 10 | $ 0 | $ 10 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | NOK | 357.254 | $ | 41.990 | 89 | 0 | 89 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 42.034 | NOK | 357.254 | 0 | (88) | (88) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | NOK | 356.585 | $ | 41.914 | 91 | 0 | 91 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 41.958 | NOK | 356.585 | 0 | (91) | (91) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 36.410 | | 319.762 | 1.094 | 0 | 1.094 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | NOK | 7.617 | $ | 896 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 37.083 | NOK | 324.183 | 940 | 0 | 940 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | | 6.244 | | 54.574 | 157 | 0 | 157 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 40.856 | | 356.566 | 984 | (19) | 965 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | NOK | 258 | $ | 30 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 3.367 | $ (199) | $ 3.168 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Investor RMB (Hedged) thesaurierend und Class E RMB (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CNH | 89.057 | $ | 12.941 | $ 0 | $ (16) | $ (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4.219 | CNH | 29.234 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 12.985 | | 89.371 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CNH | 89.057 | $ | 12.942 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 12.986 | CNH | 89.371 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 11.520 | | 79.776 | 87 | 0 | 87 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 11.975 | | 82.934 | 91 | 0 | 91 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 899 | | 6.189 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | CNH | 89.057 | $ | 12.943 | 0 | (15) | (15) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 11.350 | CNH | 78.462 | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 12.986 | | 89.371 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | | 57 | | 397 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | CNH | 2.555 | $ | 371 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 84.489 | | 12.281 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 11.389 | CNH | 78.864 | 86 | 0 | 86 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 12.318 | | 84.756 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 289 | | 1.994 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | | | $ 432 | $ (60) | $ 372 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) ausschüttend, Investor SGD (Hedged) ausschüttend, Administrative SGD (Hedged) ausschüttend und E Class SGD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 13.159 | SGD | 18.126 | $ 238 | $ 0 | $ 238 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | SGD | 955.089 | $ | 705.289 | 0 | (642) | (642) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 668.841 | SGD | 922.905 | 13.302 | 0 | 13.302 | 0,02 |
| | 08/2019 | | 707.703 | | 957.916 | 704 | 0 | 704 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 666.300 | | 915.097 | 10.071 | 0 | 10.071 | 0,01 |
| DUB | 07/2019 | | 665.916 | | 916.580 | 11.552 | 0 | 11.552 | 0,02 |
| GLM | 07/2019 | SGD | 955.018 | $ | 705.331 | 0 | (547) | (547) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 707.391 | SGD | 957.291 | 555 | 0 | 555 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SGD | 945.328 | $ | 696.683 | 0 | (2.033) | (2.033) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 13.676 | SGD | 18.746 | 179 | 0 | 179 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 729.104 | | 988.762 | 2.116 | 0 | 2.116 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 648.574 | | 893.645 | 11.941 | 0 | 11.941 | 0,02 |
| RYL | 07/2019 | | 4.693 | | 6.412 | 46 | 0 | 46 | 0,00 |
| | 08/2019 | SGD | 15.306 | $ | 11.316 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 911.337 | | 673.818 | 226 | 0 | 226 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 16.066 | SGD | 21.988 | 186 | 0 | 186 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 684.941 | | 925.981 | 6 | (156) | (150) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 18.596 | | 25.420 | 193 | 0 | 193 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 20.256 | | 27.851 | 330 | 0 | 330 | 0,00 |
| | | | | | | $ 51.645 | $ (3.381) | $ 48.264 | 0,07 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 554.216** | **0,75** |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Income Fund (Forts.)

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 76.000 | $ (80.324) | (0,11) |
| **Freddie Mac, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2049 | 41.600 | (41.983) | (0,06) |
| 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 42.700 | (43.686) | (0,06) |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 1.219.200 | (1.260.991) | (1,72) |
| 5,000 % fällig am 01.07.2049 | 520.500 | (550.662) | (0,75) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (1.977.646)** | **(2,70)** |
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 2,980 % fällig am 25.10.2019 | 103.970 | 104.075 | 0,14 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 104.075** | **0,14** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 85.036.959** | **116,10** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (11.795.395)** | **(16,10)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 73.241.564** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Reines Kapitalwertpapier.**

**(c) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(d) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(e) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(f) Nullkuponwertpapier.**

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

**(h) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

**(j) Mit dem Fonds verbunden.**

**(k) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(l) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Chester A PLC 0,000 % fällig am 17.03.2046 | 18.04.2019 | $ 267.475 | $ 262.352 | 0,36 |
| Dommo Energia S.A. | 26.12.2017 | 560 | 1.530 | 0,00 |
| Eneva S.A. | 21.12.2017 - 25.03.2019 | 303 | 412 | 0,00 |
| First Mortgage Co. 4,190 % fällig am 15.12.2024 | 17.12.2018 | 9 | 0 | 0,00 |
| Sierra Hamilton Holder LLC | 31.07.2017 | 560 | 628 | 0,00 |
| Westmoreland Mining Holdings LLC | 12.08.2014 - 26.03.2019 | 1.691 | 1.203 | 0,00 |
| | | $ 270.598 | $ 266.125 | 0,36 |

**(m) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.331.867 und Barmittel in Höhe von USD 1.346 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.092 und Barmittel in Höhe von USD 13.579 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 873.103 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 35.810 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(n) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäft, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 89.795 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | $ (91.594) | $ 89.795 | $ 89.810 | 0,12 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (91.594)** | **$ 89.795** | **$ 89.810** | **0,12** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 2.176.653 | $ 84.544.146 | $ 294.643 | $ 87.015.442 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 104.075 | 0 | 104.075 |
| Finanzderivate[3] | 78.309 | (183.708) | 487 | (104.912) |
| Leerverkäufe | 0 | (1.977.646) | 0 | (1.977.646) |
| **Summen** | **$ 2.254.962** | **$ 82.486.867** | **$ 295.130** | **$ 85.036.959** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 1.181.372 | $ 68.975.013 | $ 458.875 | $ 70.615.260 |
| Einlagen bei Kreditgenossenschaften | 0 | 104.032 | 0 | 104.032 |
| Finanzderivate[3] | 221.944 | (266.843) | 591 | (44.308) |
| **Summen** | **$ 1.403.316** | **$ 68.812.202** | **$ 459.466** | **$ 70.674.984** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 2,630 % | 10.04.2019 | 15.07.2019 | $ (141.129) | $ (141.975) | (0,19) |
| | 2,630 | 17.06.2019 | 15.07.2019 | (27.514) | (27.542) | (0,04) |
| BRC | (3,000) | 26.02.2019 | TBD[1] | € (6.182) | (6.967) | (0,01) |
| | 2,550 | 10.05.2019 | TBD[1] | $ (13.783) | (13.833) | (0,02) |
| BSN | 2,640 | 18.06.2019 | 18.07.2019 | (194.470) | (194.655) | (0,27) |
| CFR | (1,250) | 14.02.2019 | TBD[1] | € (4.952) | (5.612) | (0,01) |
| CSN | 2,660 | 17.06.2019 | 15.07.2019 | $ (37.726) | (37.765) | (0,05) |
| FOB | 1,000 | 04.02.2019 | TBD[1] | (7.233) | (7.263) | (0,01) |
| JML | (1,750) | 17.04.2019 | TBD[1] | € (3.198) | (3.631) | (0,01) |
| | 2,000 | 21.12.2018 | TBD[1] | $ (2.318) | (2.343) | 0,00 |
| MYI | (2,750) | 18.06.2019 | TBD[1] | € (806) | (917) | 0,00 |
| NOM | 2,550 | 25.06.2019 | TBD[1] | $ (2.444) | (2.445) | 0,00 |
| | 2,630 | 13.06.2019 | 31.07.2019 | (587.029) | (587.801) | (0,80) |
| | 2,630 | 21.06.2019 | 31.07.2019 | (227.742) | (227.908) | (0,31) |
| RCY | 2,650 | 17.06.2019 | 15.07.2019 | (42.977) | (43.021) | (0,06) |
| SGY | 2,250 | 14.06.2019 | 05.07.2019 | (104.806) | (104.917) | (0,14) |
| | 2,540 | 13.06.2019 | 05.07.2019 | (74.038) | (74.132) | (0,10) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (1.482.727)** | **(2,02)** |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 21.528 | $ (18.370) | $ 3.158 |
| BPS | 15.724 | (15.640) | 84 |
| BRC | (1.214) | 3.920 | 2.706 |
| BSH | 0 | (1.170) | (1.170) |
| BSS | 1.212 | 0 | 1.212 |
| CBK | 18.824 | (14.820) | 4.004 |
| CKL | (20) | 0 | (20) |
| DUB | 16.204 | (26.850) | (10.646) |
| FAR | (2.455) | 2.530 | 75 |
| FBF | 6.271 | (5.020) | 1.251 |
| GLM | 152.704 | (143.890) | 8.814 |
| GST | 8.923 | (6.690) | 2.233 |
| HUS | 166.937 | (156.630) | 10.307 |
| IND | 15.307 | (13.190) | 2.117 |
| JLN | (25) | 0 | (25) |
| JPM | 116.168 | (108.400) | 7.768 |
| JPS | 2.898 | (2.680) | 218 |
| MEI | 538 | (280) | 258 |
| MSB | 9.101 | 0 | 9.101 |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| MYC | $ (13.095) | $ 10.673 | $ (2.422) |
| MYI | (3.338) | (5.520) | (8.858) |
| NGF | 246 | (280) | (34) |
| RBC | 590 | (370) | 220 |
| RYL | 2.311 | (5.334) | (3.023) |
| SAL | 16.259 | (14.950) | 1.309) |
| SCX | (4.764) | 4.490 | (274) |
| SOG | 23.624 | (23.180) | 444 |
| SSB | (29.348) | 10.750 | (18.598) |
| TOR | 311 | (1.190) | (879) |
| UAG | 12.795 | (12.480) | 315 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 55,87 | 67,29 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 62,82 | 58,86 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,12 | 0,13 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,11 | 0,40 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,01) | (0,49) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,75 | 0,01 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,70) | 0,00 |
| Einlagenzertifikate | 0,14 | 0,19 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (2,02) | (19,56) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 3,04 | 3,76 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 29,11 | 35,93 |
| Wandelanleihen & Wechsel | 0,07 | 0,06 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,39 | 0,47 |
| US-Regierungsbehörden | 29,18 | 14,43 |
| US-Schatzobligationen | 18,57 | 24,27 |
| Non-Agency-MBS | 14,23 | 18,30 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 16,96 | 21,92 |
| Staatsemissionen | 3,67 | 3,92 |
| Stammaktien | 0,62 | 0,18 |
| Vorzugswertpapiere | 0,22 | 0,27 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 0,40 | 0,52 |
| Real Estate Investment Trusts | 0,17 | 0,20 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,14 | 0,77 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 2,04 | 1,28 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,11 | 0,40 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,02) | 0,06 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (0,03) | (0,10) |
| Zinsswaps | (0,97) | (0,45) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,01) |
| Devisenoptionen | 0,00 | (0,01) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,08) | (0,20) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,06 | (0,15) |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,01 | (0,02) |
| Devisenterminkontrakte | (0,15) | 0,28 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,92 | 0,12 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (2,70) | 0,00 |
| Einlagenzertifikate | 0,14 | 0,19 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (16,10) | (26,39) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | $ | 200 | $ 205 | 0,29 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (e)(g) | € | 200 | 234 | 0,33 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2028 (e) | $ | 60 | 63 | 0,09 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 150 | 152 | 0,21 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,610 % fällig am 15.09.2020 | | 200 | 202 | 0,29 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.12.2022 | | 100 | 102 | 0,14 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 7.700 | 1.159 | 1,63 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 7 | 1 | 0,00 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 3 | 1 | 0,00 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2050 | | 6.300 | 949 | 1,33 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2047 | | 21 | 3 | 0,01 |
| **Realkredit Danmark A/S** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.07.2047 | | 14 | 2 | 0,00 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.03.2021 | $ | 200 | 201 | 0,28 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 4,377 % fällig am 14.04.2021 | | 800 | 820 | 1,15 |
| | | | 4.094 | 5,75 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | € | 86 | 100 | 0,14 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | $ | 100 | 100 | 0,14 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | | 400 | 401 | 0,56 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | | 200 | 200 | 0,28 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 100 | 103 | 0,15 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | | 100 | 101 | 0,14 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.01.2023 | | 100 | 101 | 0,14 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 200 | 200 | 0,28 |
| **Mitsubishi Corp.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 14.07.2022 | | 300 | 302 | 0,43 |
| **Wind Tre SpA** | | | | |
| 2,625 % fällig am 20.01.2023 | € | 100 | 115 | 0,16 |
| | | | 1.723 | 2,42 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | $ | 100 | 100 | 0,14 |
| 5,150 % fällig am 15.02.2050 | | 100 | 111 | 0,16 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** | | | | |
| 2,694 % fällig am 30.06.2021 | | 100 | 100 | 0,14 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | | 160 | 160 | 0,23 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,299 % fällig am 27.01.2025 | | 106 | 113 | 0,16 |
| 5,999 % fällig am 27.01.2028 | | 116 | 123 | 0,17 |
| 7,250 % fällig am 17.03.2044 | | 400 | 448 | 0,63 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 100 | 100 | 0,14 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 3,376 % fällig am 15.02.2025 | | 35 | 37 | 0,05 |
| 4,016 % fällig am 03.12.2029 | | 226 | 245 | 0,34 |
| | | | 1.537 | 2,16 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 7.354 | 10,33 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | $ 18.700 | $ 19.116 | 26,87 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 11.100 | 11.470 | 16,11 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 2,783 % fällig am 20.02.2049 | 395 | 394 | 0,55 |
| 3,030 % fällig am 20.08.2068 | 201 | 197 | 0,28 |
| | | 31.177 | 43,81 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2021 | 399 | 395 | 0,55 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 (h) | 4.838 | 4.801 | 6,74 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 | 203 | 201 | 0,28 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (h) | 1.688 | 1.691 | 2,38 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 645 | 653 | 0,92 |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 | 2.718 | 2.738 | 3,85 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2027 | 460 | 464 | 0,65 |
| 0,625 % fällig am 15.07.2021 | 884 | 890 | 1,25 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | 57 | 58 | 0,08 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | 656 | 672 | 0,94 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | 1.466 | 1.528 | 2,15 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | 405 | 426 | 0,60 |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047 | 1.304 | 1.330 | 1,87 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | 75 | 79 | 0,11 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | 715 | 753 | 1,06 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049 | 305 | 323 | 0,45 |
| 1,125 % fällig am 15.01.2021 | 911 | 918 | 1,29 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | 110 | 125 | 0,18 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 1.701 | 1.893 | 2,66 |
| 2,125 % fällig am 15.02.2041 | 583 | 752 | 1,06 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2025 (i) | 2.413 | 2.697 | 3,79 |
| 3,375 % fällig am 15.04.2032 | 301 | 412 | 0,58 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 1,875 % fällig am 30.06.2026 (b) | 1.400 | 1.401 | 1,97 |
| | | 25.200 | 35,41 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.06.2046 | 382 | 373 | 0,52 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 4,225 % fällig am 20.01.2047 | 439 | 427 | 0,60 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2034 | 153 | 170 | 0,24 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.08.2034 | 509 | 519 | 0,73 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 | 204 | 206 | 0,29 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 4,312 % fällig am 20.04.2035 | 2 | 2 | 0,00 |
| **Grecale RMBS SRL** | | | |
| 0,188 % fällig am 27.01.2061 | € 43 | 48 | 0,07 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,983 % fällig am 20.06.2035 | $ 109 | 109 | 0,15 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 4,494 % fällig am 25.06.2035 | 3 | 3 | 0,01 |
| **New Residential Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,500 % fällig am 25.05.2058 | 345 | 366 | 0,52 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 2,583 % fällig am 20.07.2036 | 432 | 422 | 0,59 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | |
| 4,842 % fällig am 25.07.2036 | 8 | 8 | 0,01 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,734 % fällig am 25.01.2045 | 349 | 347 | 0,49 |
| 4,380 % fällig am 25.09.2033 | 3 | 3 | 0,00 |
| | | 3.003 | 4,22 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 3,184 % fällig am 25.05.2034 | 333 | 335 | 0,47 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | |
| 3,004 % fällig am 25.10.2034 | 152 | 154 | 0,22 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 3,034 % fällig am 25.02.2036 | 300 | 300 | 0,42 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,780 % fällig am 25.10.2037 | 197 | 200 | 0,28 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,549 % fällig am 25.09.2036 | $ 234 | $ 227 | 0,32 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 3,349 % fällig am 25.10.2034 | 300 | 301 | 0,42 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 2,934 % fällig am 25.02.2036 | 300 | 300 | 0,42 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | |
| 3,649 % fällig am 25.06.2035 ^ | 7 | 7 | 0,01 |
| **Encore Credit Receivables Trust** | | | |
| 3,004 % fällig am 25.01.2036 | 900 | 884 | 1,24 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,714 % fällig am 25.07.2036 | 300 | 289 | 0,40 |
| 3,184 % fällig am 25.09.2035 | 200 | 201 | 0,28 |
| 3,274 % fällig am 25.09.2035 | 500 | 500 | 0,70 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | |
| 3,259 % fällig am 25.08.2034 | 326 | 325 | 0,46 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.05.2037 | 86 | 85 | 0,12 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 3,064 % fällig am 25.01.2035 | 134 | 133 | 0,19 |
| **Navient Student Loan Trust** | | | |
| 3,554 % fällig am 25.03.2066 | 70 | 70 | 0,10 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 3,484 % fällig am 25.03.2035 | 573 | 575 | 0,81 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 2,734 % fällig am 25.04.2036 | 100 | 100 | 0,14 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | 118 | 119 | 0,17 |
| **Wachovia Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,064 % fällig am 25.10.2035 | 136 | 136 | 0,19 |
| | | 5.241 | 7,36 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | ARS 328 | 7 | 0,01 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | 21.240 | 489 | 0,69 |
| **Australia Government International Bond** | | | |
| 0,750 % fällig am 21.11.2027 | AUD 621 | 465 | 0,65 |
| 1,250 % fällig am 21.02.2022 | 768 | 560 | 0,79 |
| 3,000 % fällig am 20.09.2025 | 1.049 | 880 | 1,24 |
| **Bonos de la Tesoreria de la Republica** | | | |
| 1,500 % fällig am 01.03.2026 | CLP 13.946 | 22 | 0,03 |
| **Canadian Government Real Return Bond** | | | |
| 0,500 % fällig am 01.12.2050 (d) | CAD 209 | 169 | 0,24 |
| 1,250 % fällig am 01.12.2047 (d) | 276 | 265 | 0,37 |
| 4,250 % fällig am 01.12.2021 (d) | 229 | 193 | 0,27 |
| **Colombian TES** | | | |
| 3,500 % fällig am 10.03.2021 | COP 534.990 | 172 | 0,24 |
| **Denmark Government International Bond** | | | |
| 0,100 % fällig am 15.11.2023 (d) | DKK 3.113 | 512 | 0,72 |
| **France Government International Bond** | | | |
| 0,100 % fällig am 25.07.2021 (d) | € 608 | 713 | 1,00 |
| 0,100 % fällig am 01.03.2028 (d) | 311 | 387 | 0,54 |
| 0,100 % fällig am 25.07.2036 (d) | 422 | 539 | 0,76 |
| 1,300 % fällig am 25.07.2019 (d) | 22 | 25 | 0,04 |
| 1,800 % fällig am 25.07.2040 (d) | 359 | 622 | 0,87 |
| **Israel Government International Bond** | | | |
| 0,750 % fällig am 31.05.2027 | ILS 1.478 | 446 | 0,63 |
| 4,000 % fällig am 30.05.2036 | 1.256 | 539 | 0,76 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 0,100 % fällig am 15.05.2023 (d) | € 52 | 57 | 0,08 |
| 1,650 % fällig am 23.04.2020 (d) | 100 | 116 | 0,16 |
| 2,350 % fällig am 15.09.2024 (d) | 1.004 | 1.233 | 1,73 |
| 2,600 % fällig am 15.09.2023 (d) | 478 | 590 | 0,83 |
| **Japan Government International Bond** | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2024 (d) | ¥ 41.720 | 398 | 0,56 |
| 0,100 % fällig am 10.09.2024 (d) | 40.600 | 388 | 0,54 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2027 (d) | 61.142 | 592 | 0,83 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (d) | 85.844 | 832 | 1,17 |
| 0,100 % fällig am 10.03.2029 (d) | 50.148 | 486 | 0,68 |
| **Korea Treasury Bond Inflation Linked** | | | |
| 1,125 % fällig am 10.06.2023 | KRW 356.585 | 322 | 0,45 |
| **Mexico Government International Bond** | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2040 (d) | MXN 764 | 43 | 0,06 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Strategy Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT ($000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 4,000 % fällig am 08.11.2046 (d) | MXN | 3.000 | $ 168 | 0,24 |
| 4,500 % fällig am 04.12.2025 (d) | | 6.259 | 346 | 0,49 |
| 4,500 % fällig am 22.11.2035 (d) | | 2.228 | 131 | 0,18 |
| Peru Government International Bond | | | | |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | PEN | 700 | 234 | 0,33 |
| Qatar Government International Bond | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 200 | 210 | 0,30 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 200 | 239 | 0,34 |
| Saudi Government International Bond | | | | |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 380 | 405 | 0,57 |
| South Africa Government International Bond | | | | |
| 1,875 % fällig am 28.02.2033 (d) | ZAR | 6.715 | 401 | 0,56 |
| 2,000 % fällig am 31.01.2025 (d) | | 7.433 | 501 | 0,70 |
| 2,500 % fällig am 31.03.2046 (d) | | 606 | 36 | 0,05 |
| 2,750 % fällig am 31.01.2022 (d) | | 158 | 11 | 0,02 |
| 3,450 % fällig am 07.12.2033 (d) | | 1.369 | 98 | 0,14 |
| Spain Government International Bond | | | | |
| 0,150 % fällig am 30.11.2023 (d) | € | 205 | 245 | 0,34 |
| 0,650 % fällig am 30.11.2027 (d) | | 1.773 | 2.248 | 3,16 |
| United Kingdom Gilt | | | | |
| 0,125 % fällig am 22.03.2026 (d) | £ | 1.406 | 2.135 | 3,00 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2028 (d) | | 248 | 398 | 0,56 |
| 0,125 % fällig am 22.11.2036 (d) | | 133 | 251 | 0,35 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2041 (d) | | 175 | 354 | 0,50 |
| 0,125 % fällig am 22.03.2046 (d) | | 23 | 50 | 0,07 |
| 0,125 % fällig am 10.08.2048 (d) | | 262 | 586 | 0,82 |
| 0,750 % fällig am 22.11.2047 (d) | | 208 | 523 | 0,73 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 (d) | | 2.613 | 4.498 | 6,32 |
| 1,250 % fällig am 22.11.2032 (d) | | 305 | 606 | 0,85 |
| 1,875 % fällig am 22.11.2022 (d) | | 28 | 42 | 0,06 |
| | | | 26.778 | 37,62 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Tribune Media Co. 'A' | 1.749 | 81 | 0,12 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Hilton Worldwide Holdings, Inc. | 1.573 | 154 | 0,21 |
| Marriott International, Inc. 'A' | 799 | 112 | 0,16 |
| | | 266 | 0,37 |
| **ENERGIE** | | | |
| Antero Midstream Corp. | 15.020 | 172 | 0,24 |
| Cheniere Energy, Inc. (c) | 5.143 | 352 | 0,49 |
| Enbridge, Inc. | 3.364 | 122 | 0,17 |
| EnLink Midstream LLC | 18.859 | 190 | 0,27 |
| Kinder Morgan, Inc. | 14.222 | 297 | 0,42 |
| Marathon Petroleum Corp. | 2.179 | 122 | 0,17 |
| ONEOK, Inc. | 6.297 | 433 | 0,61 |
| Tallgrass Energy LP | 12.922 | 273 | 0,38 |
| Targa Resources Corp. | 7.459 | 293 | 0,41 |
| TC Energy Corp. | 3.564 | 177 | 0,25 |
| Valero Energy Corp. | 1.384 | 118 | 0,17 |
| Williams Cos., Inc. | 9.521 | 267 | 0,38 |
| | | 2.816 | 3,96 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Array BioPharma, Inc. (c) | 1.930 | 89 | 0,13 |
| BTG PLC (c) | 7.342 | $ 78 | 0,11 |
| Spark Therapeutics, Inc. (c) | 652 | 67 | 0,09 |
| | | 234 | 0,33 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Advanced Disposal Services, Inc. (c) | 2.819 | 90 | 0,13 |
| WABCO Holdings, Inc. (c) | 562 | 75 | 0,10 |
| | | 165 | 0,23 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Cypress Semiconductor Corp. | 4.106 | 91 | 0,13 |
| InterXion Holding NV (c) | 1.206 | 92 | 0,13 |
| Red Hat, Inc. (c) | 478 | 90 | 0,12 |
| | | 273 | 0,38 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Global Brass & Copper Holdings, Inc. | 1.174 | 51 | 0,07 |
| | | 3.886 | 5,46 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Nationwide Building Society 10,250 % | 3.685 | 710 | 1,00 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| Invesco Physical Gold ETC (f) | 29.475 | 4.040 | 5,68 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | |
| Alexandria Real Estate Equities, Inc. | 1.026 | 145 | 0,20 |
| American Campus Communities, Inc. | 1.935 | 89 | 0,12 |
| American Homes 4 Rent 'A' | 2.230 | 54 | 0,08 |
| American Tower Corp. | 275 | 56 | 0,08 |
| Apartment Investment & Management Co. | 724 | 36 | 0,05 |
| AvalonBay Communities, Inc. | 1.861 | 378 | 0,53 |
| Boston Properties, Inc. | 1.218 | 157 | 0,22 |
| Camden Property Trust | 1.453 | 152 | 0,21 |
| CoreSite Realty Corp. | 368 | 42 | 0,06 |
| Corporate Office Properties Trust | 2.406 | 63 | 0,09 |
| Crown Castle International Corp. | 589 | 77 | 0,11 |
| CyrusOne, Inc. | 469 | 27 | 0,04 |
| Digital Realty Trust, Inc. | 2.149 | 253 | 0,36 |
| Douglas Emmett, Inc. | 3.371 | 134 | 0,19 |
| Duke Realty Corp. | 3.000 | 95 | 0,13 |
| Equinix, Inc. | 346 | 175 | 0,25 |
| Equity LifeStyle Properties, Inc. | 809 | 98 | 0,14 |
| Equity Residential | 2.852 | 217 | 0,30 |
| Essex Property Trust, Inc. | 773 | 226 | 0,32 |
| Extra Space Storage, Inc. | 1.068 | 113 | 0,16 |
| Federal Realty Investment Trust | 655 | 84 | 0,12 |
| First Industrial Realty Trust, Inc. | 2.559 | 94 | 0,13 |
| HCP, Inc. | 2.604 | $ 83 | 0,12 |
| Healthcare Trust of America, Inc. 'A' | 937 | 26 | 0,04 |
| Host Hotels & Resorts, Inc. | 8.543 | 156 | 0,22 |
| Hudson Pacific Properties, Inc. | 3.628 | 121 | 0,17 |
| Invitation Homes, Inc. | 3.721 | 100 | 0,14 |
| JBG SMITH Properties | 866 | 34 | 0,05 |
| Kilroy Realty Corp. | 1.924 | 142 | 0,20 |
| Liberty Property Trust | 1.687 | 84 | 0,12 |
| Life Storage, Inc. | 831 | 79 | 0,11 |
| Mid-America Apartment Communities, Inc. | 1.445 | 170 | 0,24 |
| Prologis, Inc. | 7.374 | 591 | 0,83 |
| Public Storage | 1.995 | 475 | 0,67 |
| Regency Centers Corp. | 2.171 | 145 | 0,20 |
| Rexford Industrial Realty, Inc. | 1.918 | 77 | 0,11 |
| Ryman Hospitality Properties, Inc. | 1.492 | 121 | 0,17 |
| Sabra Health Care REIT, Inc. | 1.386 | 27 | 0,04 |
| SBA Communications Corp. (c) | 1.279 | 288 | 0,40 |
| Simon Property Group, Inc. | 2.201 | 352 | 0,49 |
| SL Green Realty Corp. | 1.195 | 96 | 0,13 |
| STORE Capital Corp. | 526 | 18 | 0,02 |
| Sun Communities, Inc. | 1.696 | 217 | 0,30 |
| Sunstone Hotel Investors, Inc. | 3.231 | 44 | 0,06 |
| Taubman Centers, Inc. | 386 | 16 | 0,02 |
| UDR, Inc. | 3.435 | 154 | 0,22 |
| Ventas, Inc. | 4.529 | 310 | 0,44 |
| Vornado Realty Trust | 2.770 | 178 | 0,25 |
| Welltower, Inc. | 2.884 | 235 | 0,33 |
| | | 7.104 | 9,98 |

| | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (j)** | | | |
| | | 640 | 0,90 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 640 | 0,90 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | 698.879 | 6.999 | 9,83 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | $ 122.132 | 171,60 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 8 | $ (2) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 1 | (1) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 113,800 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 193 | 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 134,500 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 26 | (1) | 0,00 |

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 139,000 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 26 | $ 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 150,000 EUR auf Euro-BTP 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 19 | 0 | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 6 | (15) | (0,02) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 11 | (22) | (0,03) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 178,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 72 | 0 | 0,00 |
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Short | 09/2019 | 11 | (22) | (0,03) |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09/2019 | 7 | (1) | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Short | 09/2019 | 19 | (110) | (0,16) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 132 | 237 | 0,33 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 5 | (1) | 0,00 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 65 | (245) | (0,34) |
| Euro-Schatz September Futures | Short | 09/2019 | 193 | (8) | (0,01) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 112,100 EUR auf Euro-Schatz Bond September 2019 Futures[1] | Short | 08/2019 | 41 | 2 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 154,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 69 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 159,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 49 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 160,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 30 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 169,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 6 | 7 | 0,01 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 11 | 11 | 0,01 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 114 | (179) | (0,25) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 87 | 12 | 0,02 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Long | 09/2019 | 1 | 0 | 0,00 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 3 | 3 | 0,00 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09/2019 | 10 | (5) | (0,01) |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 3 | (1) | 0,00 |
| | | | | $ (341) | (0,48) |

[1] Future-Style-Option.

## OPTIONSKAUF

### OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | $ 225,000 | 23.08.2019 | 2 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 127,000 | 23.08.2019 | 3 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 127,250 | 23.08.2019 | 10 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,250 | 23.08.2019 | 97 | 1 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 129,500 | 23.08.2019 | 6 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 130,250 | 23.08.2019 | 4 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,000 | 23.08.2019 | 21 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,500 | 23.08.2019 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 114,000 | 23.08.2019 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 123,000 | 23.08.2019 | 2 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 125,000 | 23.08.2019 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 1 | $ 0 | 0,00 |

### OPTIONEN AUF INDIZES

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfalls-datum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT S&P 500 | $ 3.250,000 | 19.07.2019 | 12 | $ 5 | $ 1 | 0,00 |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.900,000 | 19.07.2019 | 1 | 4 | 2 | 0,00 |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.800,000 | 20.09.2019 | 1 | 11 | 4 | 0,01 |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.600,000 | 20.12.2019 | 1 | 12 | 4 | 0,01 |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.700,000 | 20.03.2020 | 1 | 12 | 7 | 0,01 |
| | | | | $ 44 | $ 18 | 0,03 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### OPTIONEN AUF INDIZES

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT S&P 500 | $ 3.150,000 | 19.07.2019 | 12 | $ (3) | $ 0 | 0,00 |
| Call - CBOT S&P 500 | 3.450,000 | 19.07.2019 | 12 | (2) | (7) | (0,01) |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.825,000 | 19.07.2019 | 1 | (2) | (1) | 0,00 |
| Call - CBOT S&P 500 | 2.975,000 | 19.07.2019 | 1 | (2) | (2) | 0,00 |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.700,000 | 20.09.2019 | 1 | (9) | (2) | 0,00 |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.500,000 | 20.12.2019 | 1 | (9) | (3) | (0,01) |
| Put - CBOT S&P 500 | 2.600,000 | 20.03.2020 | 1 | (10) | (6) | (0,01) |
| | | | | $ (37 | $ (21) | (0,03) |

**Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** **$ (344) (0,48)**

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Strategy 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-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Altria Group, Inc. | (1,000) % | 20.06.2021 | $ 100 | $ 2 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 2.200 | $ 5 | 0,01 |

**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 | 2,000 % | 15.12.2047 | $ 610 | $ (4) | (0,01) |
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,499 | 20.12.2047 | 480 | (58) | (0,08) |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,650 | 02.01.2025 | BRL 5.600 | 193 | 0,27 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,945 | 02.01.2025 | 11.200 | 383 | 0,54 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 9,970 | 02.01.2025 | 1.600 | 56 | 0,08 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,300 | 02.01.2025 | 21.500 | 721 | 1,01 |
| Erhalt | 3-Month NZD-BBR | 3,250 | 21.03.2028 | NZD 200 | (19) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | $ 4.800 | (454) | (0,64) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 3,134 | 13.09.2028 | 3.600 | (163) | (0,23) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 20.03.2029 | ¥ 154.390 | (55) | (0,08) |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,066 | 15.02.2024 | € 200 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,232 | 15.12.2023 | 700 | (15) | (0,02) |
| Zahlung | CPTFEMU | 1,323 | 15.03.2029 | 500 | (10) | (0,01) |
| Erhalt | CPTFEMU | 1,535 | 15.06.2023 | 350 | 11 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,165 | 16.04.2029 | $ 500 | 12 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,954 | 03.06.2029 | 750 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,550 | 26.07.2021 | 200 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,603 | 12.09.2021 | 150 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,678 | 24.05.2021 | 800 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,801 | 12.09.2026 | 50 | 2 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,845 | 24.05.2026 | 200 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 1,955 | 25.07.2024 | 1.300 | (4) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 2,070 | 04.10.2019 | 840 | (5) | (0,01) |
| Erhalt | CPURNSA | 2,102 | 20.07.2027 | 200 | 4 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,143 | 25.04.2020 | 10 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,150 | 25.09.2027 | 300 | 6 | 0,01 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,180 | 20.09.2027 | 290 | 7 | 0,01 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,220 | 13.04.2023 | 1.380 | (32) | (0,04) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,263 | 27.04.2023 | 80 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | CPURNSA | 2,263 | 09.05.2023 | 300 | (8) | (0,01) |
| Zahlung | CPURNSA | 2,281 | 10.05.2023 | 460 | (13) | (0,02) |
| Erhalt | CPURNSA | 2,353 | 09.05.2028 | 300 | 15 | 0,02 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,360 | 09.05.2028 | 450 | 23 | 0,03 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,364 | 10.05.2028 | 460 | 23 | 0,03 |
| Erhalt | CPURNSA | 2,379 | 09.07.2028 | 300 | 16 | 0,02 |
| Zahlung | FRCPXTOB | 1,345 | 15.06.2021 | € 660 | (10) | (0,01) |
| Erhalt | FRCPXTOB | 1,590 | 15.02.2028 | 180 | 13 | 0,02 |
| Erhalt | UKRPI | 3,580 | 15.06.2039 | 60 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,590 | 15.06.2039 | 70 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,600 | 15.06.2039 | 10 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,500 | 15.09.2033 | 680 | (12) | (0,02) |
| Erhalt | UKRPI | 3,579 | 15.10.2033 | 110 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | UKRPI | 3,695 | 15.12.2028 | 480 | 12 | 0,02 |
| | | | | | $ 636 | 0,89 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 643** | **0,90** |

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

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

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

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

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

## OPTIONSKAUF

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Call - OTC USD versus INR | INR 80,500 | 18.10.2019 | 1.565 | $ 14 | $ 0 | 0,00 |

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 4,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 73,000 | 06.08.2019 | 4.000 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| FAR | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 72,500 | 06.08.2019 | 3.000 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 0 | $ 0 | 0,00 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 500 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 400 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 1.000 | (2) | (1) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 400 | 0 | 0 | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 400 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 800 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 600 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 100 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 400 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (11) | $ (2) | 0,00 |

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Put - OTC USD versus INR | INR 71,500 | 18.10.2019 | 782 | $ (13) | $ (21) | (0,03) |

### INFLATION-CAPPED OPTIONS

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | 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 |
| JPM | Cap - OTC YOY CPURNSA | 233,707 | Maximal [(3 + 0,000 %) - (Index Final/Index Initial)] oder 0 | 10.04.2020 | 700 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Floor - OTC YOY CPURNSA | 233,707 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 10.04.2020 | 700 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Floor - OTC YOY CPURNSA | 234,812 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 24.03.2020 | 800 | (9) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (23) | $ 0 | 0,00 |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Mexico Government International Bond | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 200 | $ 2 | $ (2) | $ 0 | 0,00 |
| BPS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 100 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 450 | 4 | (4) | 0 | 0,00 |
| GST | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 300 | 3 | (3) | 0 | 0,00 |
| HUS | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 350 | 3 | (3) | 0 | 0,00 |
| JPM | Mexico Government International Bond | (1,000) | 20.12.2023 | 100 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 14 | $ (14) | $ 0 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Strategy Fund (Forts.)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17.11.2059 | $ 200 | $ (6) | $ 8 | $ 2 | 0,00 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 800 | (26) | 32 | 6 | 0,01 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 400 | (12) | 15 | 3 | 0,01 |
| | | | | | $ (44) | $ 55 | $ 11 | 0,02 |

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

(2) Agiert der Teilfonds als 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.

## 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 | 0,285 % | 16.02.2020 | ILS 2.360 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,963 | 16.02.2028 | 500 | 0 | 8 | 8 | 0,01 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 300 | 0 | 4 | 4 | 0,01 |
| BRC | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 0,374 | 20.06.2020 | 1.270 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,950 | 20.06.2028 | 270 | 0 | 4 | 4 | 0,01 |
| GLM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 0,370 | 20.06.2020 | 970 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 0,270 | 21.03.2020 | 1.450 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 210 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| HUS | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 0,370 | 20.06.2020 | 770 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,988 | 20.06.2028 | 160 | 0 | 2 | 2 | 0,00 |
| JPM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 0,420 | 20.06.2020 | 1.200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 2,078 | 20.06.2028 | 260 | 0 | 4 | 4 | 0,01 |
| MYC | Erhalt | CPURNSA | 1,810 | 19.07.2026 | $ 600 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | Erhalt | CPURNSA | 1,805 | 20.09.2026 | 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Erhalt | CPURNSA | 1,800 | 20.07.2026 | 600 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | Erhalt | CPURNSA | 1,787 | 18.07.2026 | 600 | 0 | (9) | (9) | (0,02) |
| | | | | | | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | AMZX Index | 156 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 197 | 15.08.2019 | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| BPS | Erhalt | AMZX Index | 767 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 960 | 19.09.2019 | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| | Zahlung | DWRTFT Index | 144 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.611 | 13.02.2020 | 0 | 44 | 44 | 0,06 |
| | Erhalt | BCOMF1T Index | 5.071 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.642 | 14.02.2020 | 0 | 40 | 40 | 0,06 |
| | Erhalt | BCOMTR Index | 66 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 11 | 14.02.2020 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | Erhalt | AMZX Index | 277 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 349 | 20.11.2019 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | Erhalt | BCOMF1T Index | 1.357 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 439 | 14.02.2020 | 0 | 11 | 11 | 0,01 |
| GST | Erhalt | BCOMF1T Index | 2.064 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 668 | 14.02.2020 | 0 | 16 | 16 | 0,02 |
| | Zahlung | DWRTFT Index | 642 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 7.036 | 11.06.2020 | 0 | 58 | 58 | 0,08 |
| JPM | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 3.100 | 20.09.2019 | 12 | (281) | (269) | (0,38) |
| | Erhalt | BCOMF1T Index | 12.959 | 3-Month U.S. Treasury Bill-Zinssatz zzgl. eines bestimmten Spreads | 4.195 | 14.02.2020 | 0 | 102 | 102 | 0,14 |
| | Erhalt | JMABDEWE Index | 16.708 | 0,053 % | 2.520 | 14.02.2020 | 0 | 18 | 18 | 0,03 |
| MYI | Erhalt | TRNGLU Index | 450 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 2.242 | 15.07.2019 | 0 | (33) | (33) | (0,04) |
| UBS | Erhalt | TRNGLU Index | 1.205 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 5.938 | 11.06.2020 | 0 | (24) | (24) | (0,03) |
| | | | | | | | $ 12 | $ (60) | $ (48) | (0,07) |

## 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 | Erhalt | Antero Midstream Partners LP | 11.467 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 135 | 15.11.2019 | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |
| | Erhalt | Plains All American Pipeline LP | 12.783 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 302 | 15.11.2019 | 0 | 9 | 9 | 0,01 |
| | Erhalt | Energy Transfer LP | 1.195 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 17 | 20.12.2019 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Erhalt | MPLX LP | 27.740 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 868 | 20.12.2019 | 0 | 25 | 25 | 0,03 |
| | Erhalt | Phillips 66 Partners LP | 8.351 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 415 | 20.12.2019 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Erhalt | Crestwood Equity Partners LP | 6.831 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 238 | 12.02.2020 | 0 | 6 | 6 | 0,01 |
| | Erhalt | DCP Midstream LP | 13.248 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 382 | 12.02.2020 | 0 | 6 | 6 | 0,01 |
| | Erhalt | Energy Transfer LP | 75.621 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.064 | 16.03.2020 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Erhalt | ONEOK, Inc. | 693 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 45 | 15.04.2020 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| | Erhalt | Plains All American Pipeline LP | 24.847 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 587 | 15.04.2020 | 0 | 18 | 18 | 0,02 |
| | Erhalt | Targa Resources Corp. | 240 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 9 | 15.04.2020 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Erhalt | Williams Cos., Inc. | 964 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 26 | 15.04.2020 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Erhalt | Enable Midstream Partners LP | 6.404 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 84 | 15.05.2020 | 0 | 4 | 4 | 0,01 |
| | Erhalt | EQT Midstream Partners LP | 2.995 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 130 | 15.05.2020 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| CBK | Erhalt | CNX Midstream Partners LP | 3.342 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 49 | 15.01.2020 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Erhalt | Cheniere Energy Partners LP | 2.471 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 103 | 15.05.2020 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| FAR | Erhalt | Enterprise Products Partners LP | 2.075 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 60 | 15.10.2019 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GST | Erhalt | Williams Cos., Inc. | 231 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 6 | 16.09.2019 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Erhalt | EQT Midstream Partners LP | 3.652 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 159 | 12.02.2020 | 0 | 4 | 4 | 0,01 |
| MYI | Erhalt | Noble Midstream Partners LP | 4.056 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 123 | 15.07.2019 | 0 | 11 | 11 | 0,02 |
| | Erhalt | EnLink Midstream LLC | 11.168 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 116 | 30.08.2019 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Erhalt | Enterprise Products Partners LP | 18.828 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 540 | 16.09.2019 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| | Erhalt | Cheniere Energy Partners LP | 577 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 24 | 15.10.2019 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Erhalt | NuStar Energy LP | 1.304 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 34 | 15.11.2019 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Erhalt | Crestwood Equity Partners LP | 1.316 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 46 | 13.12.2019 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Erhalt | Enable Midstream Partners LP | 19.662 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 257 | 16.03.2020 | 0 | 12 | 12 | 0,02 |
| | Erhalt | NuStar Energy LP | 8.659 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 227 | 16.03.2020 | 0 | 8 | 8 | 0,01 |
| | Erhalt | Enterprise Products Partners LP | 18.919 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 543 | 15.04.2020 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| | Erhalt | Western Midstream Partners LP | 14.328 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 416 | 15.04.2020 | 0 | 25 | 25 | 0,03 |
| | Erhalt | Magellan Midstream Partners LP | 6.496 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 407 | 15.05.2020 | 0 | 8 | 8 | 0,01 |
| | | | | | | | $ 0 | $ 140 | $ 140 | 0,19 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 2.276 | AUD | 3.259 | $ 11 | $ 0 | $ 11 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 1.261 | CAD | 1.658 | 8 | 0 | 8 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 200 | CLP | 135.720 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 383 | € | 338 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 3.259 | $ | 2.278 | 0 | (11) | (11) | (0,02) |
| | 08/2019 | CAD | 1.658 | | 1.261 | 0 | (8) | (8) | (0,01) |
| | 08/2019 | CLP | 35.784 | | 53 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 552 | ILS | 1.972 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 10/2019 | DKK | 9.799 | $ | 1.504 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € | 168 | | 189 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 437 | | 557 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 6.816 | | 1.178 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Inflation Strategy Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | $ | 12.196 | £ | 9.616 | $ 42 | $ 0 | $ 42 | 0,06 |
| | 07/2019 | | 686 | NZD | 1.028 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 229 | RUB | 14.455 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 907 | TRY | 5.274 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ARS | 7.297 | $ | 162 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 9.616 | | 12.215 | 0 | (42) | (42) | (0,06) |
| | 08/2019 | NZD | 1.028 | | 686 | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 899 | RUB | 58.717 | 26 | 0 | 26 | 0,04 |
| | 09/2019 | KRW | 1.745.989 | $ | 1.473 | 0 | (39) | (39) | (0,06) |
| | 09/2019 | $ | 799 | COP | 2.699.040 | 38 | 0 | 38 | 0,05 |
| | 10/2019 | DKK | 5.355 | $ | 823 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | £ | 61 | | 77 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 10.691 | | 538 | 0 | (15) | (15) | (0,02) |
| | 10/2019 | $ | 481 | INR | 35.301 | 24 | 0 | 24 | 0,03 |
| CBK | 07/2019 | ARS | 1.793 | $ | 37 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 07/2019 | AUD | 3.259 | | 2.256 | 0 | (31) | (31) | (0,04) |
| | 07/2019 | CLP | 135.720 | | 200 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 390 | | 441 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 160 | | 203 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 144.200 | | 1.339 | 5 | (4) | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 12.238 | € | 10.768 | 25 | 0 | 25 | 0,03 |
| | 08/2019 | € | 10.768 | $ | 12.269 | 0 | (25) | (25) | (0,04) |
| | 08/2019 | $ | 349 | RUB | 22.981 | 13 | 0 | 13 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 200 | CLP | 135.720 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 48 | CNY | 333 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 783 | $ | 232 | 0 | (5) | (5) | (0,01) |
| FBF | 07/2019 | BRL | 23.487 | | 6.140 | 12 | 0 | 12 | 0,02 |
| | 08/2019 | | 6.123 | BRL | 23.487 | 0 | (12) | (12) | (0,02) |
| | 09/2019 | | 533 | INR | 37.391 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | BRL | 270 | $ | 69 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 39 | | 44 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 94 | € | 83 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 953 | IDR | 13.983.685 | 27 | 0 | 27 | 0,04 |
| | 09/2019 | | 97 | THB | 3.036 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 2.286 | MXN | 44.447 | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| HUS | 07/2019 | CAD | 1.658 | $ | 1.230 | 0 | (39) | (39) | (0,05) |
| | 07/2019 | $ | 36 | ARS | 1.793 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 20.934 | € | 18.413 | 34 | 0 | 34 | 0,05 |
| | 07/2019 | | 229 | ZAR | 3.280 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 1.148 | $ | 147 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 254 | | 186 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 229 | IDR | 3.263.479 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 270 | KRW | 311.787 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 226 | TWD | 6.963 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 17.744 | $ | 567 | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | DKK | 3.465 | | 525 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 50 | | 63 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 229 | COP | 732.216 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4.335 | € | 3.838 | 36 | 0 | 36 | 0,05 |
| | 07/2019 | | 112 | ZAR | 1.628 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 08/2019 | BRL | 6.993 | $ | 1.805 | 0 | (15) | (15) | (0,02) |
| | 10/2019 | INR | 35.349 | | 481 | 0 | (24) | (24) | (0,03) |
| | 11/2019 | TWD | 5.701 | | 182 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| MSB | 09/2019 | COP | 916.700 | | 285 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | € | 14.430 | | 16.136 | 0 | (298) | (298) | (0,42) |
| | 07/2019 | NZD | 1.028 | | 671 | 0 | (20) | (20) | (0,03) |
| | 09/2019 | $ | 136 | HKD | 1.063 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 07/2019 | COP | 732.216 | $ | 230 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 229 | COP | 732.216 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | RUB | 27.477 | $ | 434 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 8.908 | | 11.275 | 0 | (62) | (62) | (0,09) |
| | 07/2019 | $ | 5.894 | BRL | 23.757 | 306 | 0 | 306 | 0,43 |
| | 07/2019 | | 379 | RUB | 25.105 | 19 | 0 | 19 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 1.165 | TRY | 6.918 | 30 | 0 | 30 | 0,04 |
| | 11/2019 | TWD | 7.114 | $ | 227 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| UAG | 09/2019 | CNH | 414 | | 60 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR | 3.864.188 | | 270 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | MYR | 121 | | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 687 | $ (708) | $ (21) | (0,03) |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Partially Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Partially Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Partially Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 9.464 | $ 10.755 | $ 0 | $ (24) | $ (24) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ 10.783 | € 9.464 | 24 | 0 | 24 | 0,03 |
| BPS | 07/2019 | € 2.662 | $ 3.017 | 0 | (14) | (14) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ 2.358 | € 2.069 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | 10.717 | 9.582 | 195 | 0 | 195 | 0,27 |
| CBK | 07/2019 | € 9.499 | $ 10.796 | 0 | (22) | (22) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ 10.784 | € 9.464 | 22 | 0 | 22 | 0,03 |
| GLM | 07/2019 | € 13 | $ 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 221 | € 197 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 2.756 | 2.464 | 51 | 0 | 51 | 0,07 |
| | 09/2019 | 37 | HKD 291 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | € 14 | $ 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 141 | 158 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 48 | 53 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ 10.715 | € 9.582 | 197 | 0 | 197 | 0,28 |
| | | | | $ 496 | $ (63) | $ 433 | 0,61 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Partially Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | £ 815 | $ 1.034 | $ 0 | $ (3) | $ (3) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ 1.036 | £ 815 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | £ 812 | $ 1.032 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 1.004 | £ 793 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 08/2019 | 1.033 | 812 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | 24 | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 1.003 | 793 | 5 | 0 | 5 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | 227 | 180 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | $ 17 | $ (5) | $ 12 | 0,01 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 503** | **0,70** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 2.400 | $ (2.419) | (3,40) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (2.419)** | **(3,40)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 120.515** | **169,32** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (49.340)** | **(69,32)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 71.175** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

**(f) Mit dem Fonds verbunden.**

**(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(h) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 6.422 als Sicherheiten verpfändet.**

**(i) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 1.970 als Sicherheiten verpfändet.**

Barmittel in Höhe von USD 141 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für Leerverkäufe und Optionen gemäß Prime Brokerage-Vereinbarungen und Vereinbarungen, die börsennotierte Aktienoptionsgeschäfte regeln, verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 1.400 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 620 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 1,350 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 640 | U.S. Treasury Bonds 2,000 % fällig am 31.08.2047 | $ (658) | $ 640 | $ 640 | 0,90 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (658)** | **$ 640** | **$ 640** | **0,90** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

Bewertung zum Marktwert[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 22.029 | $ 100.103 | $ 0 | $ 122.132 |
| Finanzderivate[3] | (341) | 1.143 | 0 | 802 |
| Leerverkäufe | 0 | (2.419) | 0 | (2.419) |
| **Summen** | **$ 21.688** | **$ 98.827** | **$ 0** | **$ 120.515** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 13.830 | $ 97.570 | $ 0 | $ 111.400 |
| Finanzderivate[3] | (418) | (28) | 0 | (446) |
| Leerverkäufe | 0 | (2.339) | 0 | (2.339) |
| **Summen** | **$ 13.412** | **$ 95.203** | **$ 0** | **$ 108.615** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 3,050 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ (1.504) | $ (1.504) | (2,11) |
| | 2,680 | 28.06.2019 | 05.07.2019 | (4.772) | (4.773) | (6,71) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (6.277)** | **(8,82)** |

Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkaufgeschäfte | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| TDM | 2,550 % | 03.04.2019 | 03.07.2019 | $ (1.934) | $ (1.946) | (2,73) |
| **Summe Rückkaufgeschäfte** | | | | | **$ (1.946)** | **(2,73)** |

Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 82 | $ 0 | $ 82 |
| BPS | 93 | 0 | 93 |
| BRC | 186 | 0 | 186 |
| CBK | (20) | 0 | (20) |
| DUB | 0 | (10) | (10) |
| FBF | 4 | 0 | 4 |
| GLM | 24 | 0 | 24 |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| GST | $ 79 | $ 0 | $ 79 |
| HUS | (8) | 0 | (8) |
| JPM | (153) | 320 | 167 |
| MYC | (20) | 0 | (20) |
| MYI | (232) | 300 | 68 |
| SCX | 292 | (260) | 32 |
| SSB | 1 | 0 | 1 |
| TOR | 197 | 0 | 197 |
| UAG | 2 | 0 | 2 |
| UBS | (24) | 0 | (24) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 95,38 | 87,60 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 75,32 | 57,80 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,90 | 0,83 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,48) | (0,51) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,90 | 1,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,70 | (1,08) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (3,40) | (3,07) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (8,82) | (24,06) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (2,73) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 10,33 | 10,36 |
| US-Regierungsbehörden | 43,81 | 25,78 |
| US-Schatzobligationen | 35,41 | 51,60 |
| Non-Agency-MBS | 4,22 | 0,99 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 7,36 | 5,35 |
| Staatsemissionen | 37,62 | 29,47 |
| Stammaktien | 5,46 | 3,18 |
| Vorzugswertpapiere | 1,00 | 0,86 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 5,68 | 6,92 |
| Real Estate Investment Trusts | 9,98 | 7,84 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,90 | 3,64 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 9,83 | 0,24 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,48) | (0,52) |
| Optionskauf | | |
| Optionen auf Indizes | 0,03 | 0,18 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | 0,00 | (0,04) |
| Optionen auf Indizes | (0,03 | (0,13) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | 0,22 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Zinsswaps | 0,89 | 0,78 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,01) |
| Devisenoptionen | (0,03) | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,02 | (0,02) |
| Zinsswaps | 0,00 | (0,04) |
| Total Return Swaps auf Indizes | (0,07) | (0,71) |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | 0,19 | (0,63) |
| Devisenterminkontrakte | (0,03) | 0,25 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,62 | 0,09 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (3,40) | (3,07) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (69,32) | (42,57) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/ GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **AIG Global Funding** | | | | |
| 2,809 % fällig am 25.06.2021 | $ | 3.100 | $ 3.113 | 0,28 |
| **American Express Co.** | | | | |
| 3,165 % fällig am 05.11.2021 | | 3.200 | 3.218 | 0,29 |
| 3,375 % fällig am 17.05.2021 | | 700 | 713 | 0,06 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | | 7.100 | 7.117 | 0,64 |
| **Australia & New Zealand Banking Group Ltd.** | | | | |
| 2,985 % fällig am 17.05.2021 | | 3.900 | 3.914 | 0,35 |
| 3,300 % fällig am 17.05.2021 | | 4.000 | 4.074 | 0,37 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 3,253 % fällig am 30.07.2021 | | 2.100 | 2.094 | 0,19 |
| 3,470 % fällig am 01.06.2021 | | 3.100 | 3.117 | 0,28 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 3,948 % fällig am 15.02.2023 | | 3.500 | 3.484 | 0,31 |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | | 4.500 | 4.658 | 0,42 |
| 4,655 % fällig am 10.08.2021 | | 3.700 | 3.783 | 0,34 |
| **Brixmor Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,629 % fällig am 01.02.2022 | | 3.500 | 3.501 | 0,31 |
| **Capital One Financial Corp.** | | | | |
| 2,400 % fällig am 30.10.2020 | | 4.100 | 4.105 | 0,37 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 3,272 % fällig am 27.10.2022 | | 5.400 | 5.409 | 0,48 |
| 3,710 % fällig am 30.03.2021 | | 5.200 | 5.286 | 0,47 |
| **Compass Bank** | | | | |
| 3,181 % fällig am 11.06.2021 | | 3.900 | 3.898 | 0,35 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 3,601 % fällig am 24.04.2023 | | 4.450 | 4.442 | 0,40 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 4,891 % fällig am 16.04.2021 | | 3.900 | 4.025 | 0,36 |
| **Danske Bank A/S** | | | | |
| 5,000 % fällig am 12.01.2022 | | 3.000 | 3.139 | 0,28 |
| **DBS Bank Ltd.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 27.11.2021 | | 3.800 | 3.895 | 0,35 |
| **Deutsche Pfandbriefbank AG** | | | | |
| 3,375 % fällig am 22.11.2021 | | 5.000 | 5.141 | 0,46 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,597 % fällig am 04.11.2019 | | 2.200 | 2.199 | 0,20 |
| 2,681 % fällig am 09.01.2020 | | 1.700 | 1.699 | 0,15 |
| 3,273 % fällig am 24.09.2020 | | 3.400 | 3.398 | 0,30 |
| 3,592 % fällig am 09.01.2020 | | 1.500 | 1.503 | 0,13 |
| 5,085 % fällig am 07.01.2021 | | 1.800 | 1.855 | 0,17 |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 | | 3.700 | 3.767 | 0,34 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2021 | | 900 | 937 | 0,08 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 13.07.2020 | | 2.200 | 2.208 | 0,20 |
| 4,157 % fällig am 15.01.2020 | | 6.700 | 6.739 | 0,60 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,274 % fällig am 23.02.2023 | | 3.500 | 3.491 | 0,31 |
| 3,610 % fällig am 15.09.2020 | | 3.800 | 3.837 | 0,34 |
| 3,696 % fällig am 26.04.2022 | | 2.100 | 2.118 | 0,19 |
| 3,940 % fällig am 23.04.2021 | | 3.200 | 3.249 | 0,29 |
| 6,000 % fällig am 15.06.2020 | | 2.000 | 2.067 | 0,19 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | | |
| 3,022 % fällig am 21.05.2020 | | 4.000 | 4.002 | 0,36 |
| 3,460 % fällig am 02.03.2021 | | 3.100 | 3.096 | 0,28 |
| **HSBC Bank Canada** | | | | |
| 3,300 % fällig am 28.11.2021 | | 3.200 | 3.296 | 0,30 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,086 % fällig am 11.09.2021 | | 3.300 | 3.304 | 0,30 |
| 3,120 % fällig am 18.05.2021 | | 3.800 | 3.804 | 0,34 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 4.515 | 4.873 | 0,44 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | | |
| 2,897 % fällig am 15.10.2020 | | 3.200 | 3.207 | 0,29 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 3,480 % fällig am 25.04.2023 | | 3.300 | 3.317 | 0,30 |
| 4,000 % fällig am 01.03.2021 | | 5.000 | 5.090 | 0,46 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | | |
| 2,926 % fällig am 26.04.2021 | | 8.000 | 8.011 | 0,72 |
| 2,970 % fällig am 19.10.2020 | | 3.200 | 3.203 | 0,29 |
| 3,086 % fällig am 26.04.2021 | | 3.050 | 3.068 | 0,27 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 3,055 % fällig am 07.05.2021 | $ | 4.100 | $ 4.100 | 0,37 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | € | 4.800 | 5.658 | 0,51 |
| **Macquarie Bank Ltd.** | | | | |
| 3,702 % fällig am 29.07.2020 | $ | 8.600 | 8.691 | 0,78 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,260 % fällig am 02.03.2023 | | 8.400 | 8.402 | 0,75 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,086 % fällig am 19.07.2023 | AUD | 4.800 | 3.395 | 0,30 |
| 3,269 % fällig am 05.03.2023 | $ | 500 | 500 | 0,04 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | € | 2.300 | 2.634 | 0,24 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | | |
| 2,975 % fällig am 17.05.2021 | $ | 4.800 | 4.803 | 0,43 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 9.900 | 9.924 | 0,89 |
| **Regions Bank** | | | | |
| 3,035 % fällig am 13.08.2021 | | 3.900 | 3.898 | 0,35 |
| **Reliance Standard Life Global Funding** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2020 | | 1.900 | 1.899 | 0,17 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 3,350 % fällig am 22.10.2021 | | 6.400 | 6.584 | 0,59 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 6,400 % fällig am 21.10.2019 | | 2.600 | 2.630 | 0,24 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 3,140 % fällig am 01.06.2021 | | 3.900 | 3.910 | 0,35 |
| **SMBC Trust Account** | | | | |
| 3,792 % fällig am 09.04.2021 | | 5.000 | 4.977 | 0,45 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 3,742 % fällig am 20.01.2023 | | 3.200 | 3.200 | 0,29 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 2,092 % fällig am 18.10.2019 | | 1.300 | 1.299 | 0,12 |
| 2,971 % fällig am 16.10.2020 | | 3.000 | 3.005 | 0,27 |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | |
| 2,995 % fällig am 24.05.2021 | | 3.800 | 3.818 | 0,34 |
| **Synchrony Financial** | | | | |
| 3,806 % fällig am 03.02.2020 | | 5.100 | 5.121 | 0,46 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | |
| 3,350 % fällig am 22.10.2021 | | 3.900 | 4.016 | 0,36 |
| **U.S. Bank N.A.** | | | | |
| 2,906 % fällig am 26.04.2021 | | 6.700 | 6.712 | 0,60 |
| 3,150 % fällig am 26.04.2021 | | 6.700 | 6.824 | 0,61 |
| **UBS AG** | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.12.2020 | | 3.900 | 3.906 | 0,35 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 4,377 % fällig am 14.04.2021 | | 6.700 | 6.864 | 0,62 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 6,497 % fällig am 14.01.2022 | | 3.200 | 3.330 | 0,30 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 5.350 | 6.116 | 0,55 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 1,159 % fällig am 01.08.2022 | € | 2.600 | 3.014 | 0,27 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | | |
| 3,092 % fällig am 23.07.2021 | $ | 3.600 | 3.604 | 0,32 |
| 3,141 % fällig am 27.05.2022 | | 4.200 | 4.210 | 0,38 |
| | | | 306.508 | 27,50 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.11.2021 | | 3.400 | 3.459 | 0,31 |
| **Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 29.07.2020 | | 4.200 | 4.228 | 0,38 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2019 | | 1.382 | 1.388 | 0,12 |
| **Anthem, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 21.11.2020 | | 2.600 | 2.606 | 0,23 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | | 4.900 | 4.913 | 0,44 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,979 % fällig am 25.06.2021 | | 3.100 | 3.080 | 0,28 |
| **Broadcom Corp.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.01.2021 | | 500 | 496 | 0,04 |
| 2,375 % fällig am 15.01.2020 | | 3.700 | 3.694 | 0,33 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2021 | | 2.700 | 2.718 | 0,24 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 2,910 % fällig am 16.03.2020 | $ | 7.200 | $ 7.206 | 0,65 |
| 3,040 % fällig am 15.03.2021 | | 3.300 | 3.294 | 0,30 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 2,978 % fällig am 15.02.2022 | | 7.000 | 6.983 | 0,63 |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | | 2.400 | 2.404 | 0,22 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 3.700 | 3.734 | 0,33 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 1.400 | 1.472 | 0,13 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | |
| 3,092 % fällig am 09.10.2020 | | 2.000 | 1.996 | 0,18 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 3,083 % fällig am 09.03.2020 | | 5.100 | 5.113 | 0,46 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | |
| 2,955 % fällig am 04.05.2020 | | 4.100 | 4.104 | 0,37 |
| 2,965 % fällig am 12.02.2021 | | 3.150 | 3.148 | 0,28 |
| 3,403 % fällig am 22.02.2022 | | 3.000 | 3.019 | 0,27 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 19.04.2021 | | 800 | 812 | 0,07 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 1,950 % fällig am 19.09.2021 | | 900 | 891 | 0,08 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 3,097 % fällig am 20.09.2019 | | 1.500 | 1.502 | 0,13 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.12.2019 | | 2.300 | 2.298 | 0,21 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 05.06.2020 | | 500 | 499 | 0,04 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 500 | 497 | 0,04 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | | 350 | 356 | 0,03 |
| **Equifax, Inc.** | | | | |
| 3,388 % fällig am 15.08.2021 | | 4.700 | 4.689 | 0,42 |
| **GATX Corp.** | | | | |
| 3,285 % fällig am 05.11.2021 | | 3.700 | 3.686 | 0,33 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 17.05.2022 | € | 2.200 | 2.520 | 0,23 |
| **Georgia-Pacific LLC** | | | | |
| 2,539 % fällig am 15.11.2019 | $ | 4.800 | 4.800 | 0,43 |
| **GlaxoSmithKline Capital PLC** | | | | |
| 2,878 % fällig am 14.05.2021 | | 4.000 | 4.010 | 0,36 |
| **Harris Corp.** | | | | |
| 3,063 % fällig am 30.04.2020 | | 3.600 | 3.599 | 0,32 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.02.2020 | | 500 | 512 | 0,05 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 3,202 % fällig am 18.09.2020 | | 3.400 | 3.403 | 0,31 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.07.2020 | | 2.100 | 2.106 | 0,19 |
| **Keurig Dr Pepper, Inc.** | | | | |
| 3,551 % fällig am 25.05.2021 | | 5.600 | 5.723 | 0,51 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.06.2021 | | 2.400 | 2.441 | 0,22 |
| **Marriott International, Inc.** | | | | |
| 3,120 % fällig am 01.12.2020 | | 3.200 | 3.213 | 0,29 |
| **McDonald's Corp.** | | | | |
| 3,012 % fällig am 28.10.2021 | | 3.900 | 3.904 | 0,35 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | | 390 | 409 | 0,04 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | | |
| 3,922 % fällig am 01.06.2021 | | 1.700 | 1.731 | 0,16 |
| **Mondelez International, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 07.05.2020 | | 5.000 | 5.021 | 0,45 |
| **Mylan NV** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.12.2020 | | 1.200 | 1.212 | 0,11 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 21.07.2021 | | 1.800 | 1.785 | 0,16 |
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 15.09.2021 | | 7.500 | 7.465 | 0,67 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 23.09.2020 | | 1.650 | 1.684 | 0,15 |
| **Pernod Ricard S.A.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.01.2022 | | 3.100 | 3.245 | 0,29 |
| **Shire Acquisitions Investments Ireland DAC** | | | | |
| 1,900 % fällig am 23.09.2019 | | 3.000 | 2.996 | 0,27 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Sky Ltd.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 16.09.2019 | $ | 1.000 | $ | 1.000 | 0,09 |
| **Southern Co.** | | | | | |
| 3,019 % fällig am 30.09.2020 | | 3.200 | | 3.201 | 0,29 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | | 3.300 | | 3.324 | 0,30 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | | |
| 3,800 % fällig am 26.11.2020 | | 2.500 | | 2.546 | 0,23 |
| **United Technologies Corp.** | | | | | |
| 3,175 % fällig am 16.08.2021 | | 3.800 | | 3.802 | 0,34 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | | |
| 3,475 % fällig am 12.11.2021 | | 3.800 | | 3.832 | 0,34 |
| 4,000 % fällig am 12.11.2021 | | 3.800 | | 3.924 | 0,35 |
| | | | | 167.693 | 15,04 |

**VERSORGUNGSUNTERNEHMEN**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **American Electric Power Co., Inc.** | | | | | |
| 2,150 % fällig am 13.11.2020 | | 2.300 | | 2.295 | 0,20 |
| **AT&T, Inc.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.06.2022 | | 300 | | 305 | 0,03 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 400 | | 404 | 0,04 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.10.2021 | | 1.250 | | 1.293 | 0,12 |
| **DTE Energy Co.** | | | | | |
| 2,400 % fällig am 01.12.2019 | | 1.900 | | 1.900 | 0,17 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | | |
| 2,921 % fällig am 21.08.2020 | | 4.300 | | 4.298 | 0,38 |
| 3,342 % fällig am 01.09.2020 | | 4.400 | | 4.451 | 0,40 |
| **Sempra Energy** | | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 4.000 | | 3.985 | 0,36 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 28.04.2020 | | 1.000 | | 1.000 | 0,09 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | | |
| 3,410 % fällig am 16.03.2022 | | 2.700 | | 2.742 | 0,24 |
| | | | | 22.673 | 2,03 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | | 496.874 | 44,57 |

**US-REGIERUNGSBEHÖRDEN**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **Fannie Mae** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.04.2040 (b)(c) | | 278 | | 238 | 0,02 |
| 1,000 % fällig am 25.01.2043 | | 221 | | 211 | 0,02 |
| 2,754 % fällig am 25.12.2036 - 25.03.2044 | | 3.387 | | 3.386 | 0,30 |
| 2,757 % fällig am 25.07.2037 | | 53 | | 52 | 0,01 |
| 2,814 % fällig am 25.09.2035 | | 276 | | 276 | 0,03 |
| 3,330 % fällig am 01.11.2023 | | 5.123 | | 5.359 | 0,48 |
| 3,682 % fällig am 01.07.2042 - 01.06.2043 | | 86 | | 87 | 0,01 |
| 3,732 % fällig am 01.09.2041 | | 101 | | 101 | 0,01 |
| 4,315 % fällig am 01.01.2035 | | 14 | | 14 | 0,00 |
| 4,530 % fällig am 01.12.2034 | | 7 | | 7 | 0,00 |
| 4,534 % fällig am 01.08.2035 | | 217 | | 229 | 0,02 |
| 4,561 % fällig am 01.07.2035 | | 9 | | 9 | 0,00 |
| 4,580 % fällig am 01.12.2034 | | 32 | | 33 | 0,00 |
| 4,607 % fällig am 01.05.2038 | | 1.515 | | 1.590 | 0,14 |
| 4,609 % fällig am 01.01.2035 | | 8 | | 8 | 0,00 |
| 4,710 % fällig am 01.01.2035 | | 54 | | 57 | 0,01 |
| 4,800 % fällig am 01.03.2035 | | 2 | | 2 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2047 | | 66.359 | | 68.805 | 6,17 |
| 4,000 % fällig am 01.06.2048 | | 69.189 | | 71.764 | 6,44 |
| 4,000 % fällig am 01.11.2048 (f) | | 86.307 | | 89.260 | 8,01 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2019 - 01.03.2021 | | 19 | | 20 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2025 - 01.10.2031 | | 2.010 | | 2.125 | 0,19 |
| 5,500 % fällig am 01.02.2027 - 01.03.2028 | | 17 | | 18 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.04.2035 - 01.01.2041 | | 2.157 | | 2.446 | 0,22 |
| 6,500 % fällig am 01.12.2035 - 01.01.2036 | | 16 | | 19 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.09.2049 | | 3.000 | | 3.021 | 0,27 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 2.300 | | 2.351 | 0,21 |
| 6,000 % fällig am 01.07.2049 | | 1.000 | | 1.095 | 0,10 |
| **Freddie Mac** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.05.2037 (b)(c) | | 282 | | 262 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 15.11.2026 | $ | 7.024 | $ | 7.024 | 0,63 |
| 2,714 % fällig am 15.02.2037 | | 39 | | 39 | 0,00 |
| 2,794 % fällig am 15.06.2041 | | 2.026 | | 2.028 | 0,18 |
| 2,844 % fällig am 15.09.2041 | | 12 | | 13 | 0,00 |
| 3,488 % fällig am 25.02.2045 | | 136 | | 136 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2048 (f) | | 56.085 | | 58.341 | 5,23 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2048 | | 1.840 | | 1.906 | 0,17 |
| 4,521 % fällig am 01.09.2035 | | 231 | | 243 | 0,02 |
| 4,542 % fällig am 01.07.2035 | | 29 | | 31 | 0,00 |
| 4,734 % fällig am 01.12.2034 | | 6 | | 6 | 0,00 |
| 4,833 % fällig am 01.01.2035 | | 6 | | 6 | 0,00 |
| 4,885 % fällig am 01.01.2035 | | 14 | | 15 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.05.2022 - 01.12.2023 | | 12 | | 12 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.07.2043 | | 113 | | 133 | 0,01 |
| **Ginnie Mae** | | | | | |
| 2,953 % fällig am 20.06.2065 | | 2.644 | | 2.643 | 0,24 |
| 3,209 % fällig am 20.10.2065 | | 724 | | 725 | 0,07 |
| 3,309 % fällig am 20.05.2066 | | 2.129 | | 2.145 | 0,19 |
| 3,367 % fällig am 20.04.2066 | | 3.159 | | 3.197 | 0,29 |
| 3,524 % fällig am 20.07.2067 | | 9.557 | | 9.738 | 0,87 |
| 3,557 % fällig am 20.02.2062 | | 52 | | 52 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 20.06.2027 | | 35 | | 36 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 20.06.2048 | | 2.071 | | 2.167 | 0,20 |
| 5,000 % fällig am 20.12.2048 - 20.06.2049 | | 20.869 | | 21.917 | 1,97 |
| 5,000 % fällig am 20.02.2049 (f) | | 24.501 | | 25.727 | 2,31 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.08.2049 | | 28.500 | | 29.693 | 2,66 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2049 | | 24.900 | | 26.033 | 2,34 |
| | | | | 446.851 | 40,08 |

**US-SCHATZOBLIGATIONEN**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)** | | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 (f) | | 48.853 | | 48.480 | 4,35 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 | | 7.551 | | 7.562 | 0,68 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2023 (f)(g) | | 45.783 | | 46.168 | 4,14 |
| 0,625 % fällig am 15.04.2023 (f)(g) | | 67.067 | | 67.872 | 6,09 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 (f)(g) | | 16.696 | | 17.581 | 1,57 |
| | | | | 187.663 | 16,83 |

**NON-AGENCY-MBS**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | | |
| 4,213 % fällig am 25.10.2034 | | 19 | | 19 | 0,00 |
| 4,544 % fällig am 25.02.2045 | | 52 | | 53 | 0,01 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | | | |
| 4,658 % fällig am 25.08.2034 | | 1.006 | | 1.044 | 0,09 |
| 4,689 % fällig am 25.07.2034 | | 29 | | 31 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.10.2031 | | 5 | | 5 | 0,00 |
| **BankUnited Trust** | | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.09.2045 | | 1.841 | | 1.831 | 0,16 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | | | |
| 4,236 % fällig am 25.11.2034 | | 85 | | 85 | 0,01 |
| 4,314 % fällig am 25.07.2034 | | 206 | | 203 | 0,02 |
| 4,427 % fällig am 25.01.2035 | | 19 | | 19 | 0,00 |
| 4,886 % fällig am 25.01.2034 | | 16 | | 17 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.02.2034 | | 101 | | 103 | 0,01 |
| 4,355 % fällig am 25.12.2033 | | 66 | | 67 | 0,01 |
| **Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.12.2018 | | 1 | | 1 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,820 % fällig am 25.10.2035 | | 38 | | 39 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2033 | | 14 | | 15 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,280 % fällig am 25.11.2034 | | 74 | | 75 | 0,01 |
| 4,285 % fällig am 20.02.2035 | | 55 | | 55 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | | |
| 4,018 % fällig am 26.09.2047 | | 57 | | 57 | 0,01 |
| **European Loan Conduit** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 26.10.2028 | € | 2.901 | | 3.302 | 0,30 |
| **Eurosail PLC** | | | | | |
| 1,739 % fällig am 13.06.2045 | £ | 6.818 | | 8.655 | 0,78 |
| **FirstMac Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 2,418 % fällig am 08.03.2049 | AUD | 4.487 | | 3.139 | 0,28 |
| 2,668 % fällig am 08.03.2049 | | 8.000 | | 5.586 | 0,50 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 2,532 % fällig am 18.06.2039 | $ | 1.440 | $ | 1.401 | 0,13 |
| **GS Mortgage Securities Corp. Trust** | | | | | |
| 3,980 % fällig am 10.02.2029 | | 3.400 | | 3.448 | 0,31 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 25.09.2035 | | 212 | | 218 | 0,02 |
| **Holmes Master Issuer PLC** | | | | | |
| 2,957 % fällig am 15.10.2054 | | 3.011 | | 3.009 | 0,27 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.04.2035 | | 481 | | 470 | 0,04 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 1,924 % fällig am 15.10.2045 (a) | | 12.151 | | 552 | 0,05 |
| **Juno Eclipse Ltd.** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 20.11.2022 | € | 291 | | 325 | 0,03 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.11.2035 | $ | 3 | | 3 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,533 % fällig am 25.10.2034 | | 1.017 | | 1.053 | 0,10 |
| **MortgageIT Trust** | | | | | |
| 3,044 % fällig am 25.02.2035 | | 223 | | 225 | 0,02 |
| **Mulcair Securities DAC** | | | | | |
| 0,695 % fällig am 24.04.2071 | € | 4.600 | | 5.248 | 0,47 |
| **Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,684 % fällig am 25.12.2035 | $ | 620 | | 584 | 0,05 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | | |
| 2,511 % fällig am 16.09.2059 | AUD | 5.148 | | 3.602 | 0,32 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.02.2034 | $ | 5 | | 5 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | | |
| 2,593 % fällig am 20.06.2036 | | 555 | | 539 | 0,05 |
| 3,183 % fällig am 20.10.2027 | | 6 | | 6 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 4,054 % fällig am 25.01.2035 | | 576 | | 580 | 0,05 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | | |
| 2,640 % fällig am 19.07.2035 | | 34 | | 34 | 0,00 |
| **Taurus IT SRL** | | | | | |
| 1,188 % fällig am 18.02.2027 | € | 1.182 | | 1.345 | 0,12 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | | |
| 3,084 % fällig am 25.04.2043 | $ | 2 | | 2 | 0,00 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 6.500 | | 8.304 | 0,75 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | | |
| 3,084 % fällig am 25.01.2045 | $ | 1.051 | | 1.044 | 0,09 |
| 3,904 % fällig am 25.06.2042 | | 13 | | 13 | 0,00 |
| **Wells Fargo Commercial Mortgage Trust** | | | | | |
| 1,933 % fällig am 15.10.2045 (a) | | 2.837 | | 132 | 0,01 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 4,904 % fällig am 25.03.2035 | | 1.651 | | 1.707 | 0,15 |
| 4,973 % fällig am 25.12.2034 | | 25 | | 26 | 0,00 |
| 4,986 % fällig am 25.01.2035 | | 31 | | 32 | 0,00 |
| | | | | 58.308 | 5,23 |

**FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **Adams Mill CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,697 % fällig am 15.07.2026 | | 4.178 | | 4.181 | 0,37 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 3,424 % fällig am 25.10.2034 | | 3.100 | | 3.136 | 0,28 |
| **Cairn CLO BV** | | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | € | 3.000 | | 3.426 | 0,31 |
| **Chesapeake Funding LLC** | | | | | |
| 3,230 % fällig am 15.08.2030 | $ | 2.573 | | 2.608 | 0,23 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | | | |
| 3,377 % fällig am 15.04.2027 | | 5.200 | | 5.197 | 0,47 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.11.2034 | | 1.744 | | 1.753 | 0,16 |
| **Credit Acceptance Auto Loan Trust** | | | | | |
| 3,470 % fällig am 17.05.2027 | | 2.400 | | 2.436 | 0,22 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | | |
| 3,024 % fällig am 25.01.2032 | | 17 | | 17 | 0,00 |
| **Evans Grove CLO Ltd.** | | | | | |
| 3,441 % fällig am 28.05.2028 | | 3.900 | | 3.879 | 0,35 |
| **Exeter Automobile Receivables Trust** | | | | | |
| 2,900 % fällig am 18.01.2022 | | 1.173 | | 1.174 | 0,11 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Average Duration Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Figueroa CLO Ltd.** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.01.2027 | $ | 3.472 | $ 3.469 | 0,31 |
| **Ford Credit Auto Owner Trust** | | | | |
| 2,440 % fällig am 15.01.2027 | | 2.700 | 2.704 | 0,24 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 3,109 % fällig am 25.04.2035 | | 1.334 | 1.340 | 0,12 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | |
| 3,642 % fällig am 21.01.2028 | | 3.600 | 3.597 | 0,32 |
| **Gracechurch Card Funding PLC** | | | | |
| 2,794 % fällig am 15.07.2022 | | 4.300 | 4.301 | 0,39 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,109 % fällig am 25.08.2035 | | 644 | 647 | 0,06 |
| **Navient Student Loan Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 26.07.2066 | | 149 | 149 | 0,01 |
| **Nelnet Student Loan Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 23.08.2027 | | 2.066 | 2.063 | 0,19 |
| 4,171 % fällig am 25.11.2024 | | 3.307 | 3.309 | 0,30 |
| **Palmer Square CLO Ltd.** | | | | |
| 3,368 % fällig am 15.08.2026 | | 2.992 | 2.981 | 0,27 |
| **Palmer Square Loan Funding Ltd.** | | | | |
| 3,247 % fällig am 15.07.2026 | | 3.296 | 3.277 | 0,29 |
| **RAAC Trust** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.03.2037 | | 266 | 267 | 0,02 |
| **Red & Black Auto Germany UG** | | | | |
| 0,124 % fällig am 15.01.2027 | € | 3.994 | 4.569 | 0,41 |
| **Silver Arrow Compartment** | | | | |
| 1,073 % fällig am 20.07.2023 | £ | 545 | 693 | 0,06 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | |
| 2,510 % fällig am 15.09.2026 | $ | 1.666 | 1.663 | 0,15 |
| 2,520 % fällig am 15.03.2027 | | 2.078 | 2.068 | 0,19 |
| 2,678 % fällig am 15.05.2023 | | 2.820 | 2.817 | 0,25 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 2,670 % fällig am 25.10.2024 | $ | 834 | $ 833 | 0,07 |
| 2,670 % fällig am 26.01.2026 | | 3.717 | 3.705 | 0,33 |
| 2,730 % fällig am 25.10.2029 | | 3.228 | 3.194 | 0,29 |
| 3,080 % fällig am 25.04.2024 | | 887 | 888 | 0,08 |
| **South Carolina Student Loan Corp.** | | | | |
| 3,520 % fällig am 03.09.2024 | | 596 | 600 | 0,05 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 3,379 % fällig am 25.10.2033 | | 385 | 386 | 0,03 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,079 % fällig am 25.11.2035 | | 872 | 876 | 0,08 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 3,321 % fällig am 28.02.2026 | | 3.940 | 3.929 | 0,35 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 25.07.2026 | | 3.439 | 3.436 | 0,31 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.05.2036 | | 243 | 243 | 0,02 |
| **WhiteHorse Ltd.** | | | | |
| 3,518 % fällig am 17.04.2027 | | 4.000 | 3.994 | 0,36 |
| **Zais CLO Ltd.** | | | | |
| 3,747 % fällig am 15.04.2028 | | 3.400 | 3.407 | 0,31 |
| | | | 93.212 | 8,36 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.03.2021 | | 6.600 | 6.686 | 0,60 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 2,000 % fällig am 08.09.2020 | | 6.700 | 6.685 | 0,60 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 30.04.2020 | € | 8.900 | 10.507 | 0,94 |
| | | | 23.878 | 2,14 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (e)** | 3.026.370 | $ 30.536 | 2,74 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (e)** | 734.360 | 74.530 | 6,69 |
| | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (h)** | | 8.109 | 0,73 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 8.109 | 0,73 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)** | 487.323 | 4.881 | 0,44 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 1.424.842** | **127,81** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 907 | $ (110) | (0,01) |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 83 | (50) | (0,01) |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 77 | (116) | (0,01) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 246 | 698 | 0,06 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 257 | (960) | (0,09) |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 36 | (158) | (0,01) |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 844 | 1.072 | 0,10 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 2.805 | 3.554 | 0,32 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 190 | 41 | 0,00 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09/2019 | 28 | (23) | 0,00 |
| | | | | $ 3.948 | 0,35 |

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | $ 145,500 | 23.08.2019 | 388 | $ 3 | $ 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 108,000 | 23.08.2019 | 1.064 | 9 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 12 | $ 1 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 3.949** | **0,35** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| General Electric Co. | 1,000 % | 20.12.2020 | $ 1.300 | $ 53 | 0,00 |

## ZINSSWAPS

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 % | 20.06.2028 | $ 19.600 | $ (1.595) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.12.2027 | 22.400 | (1.764) | (0,16) |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2029 | £ 19.000 | (903) | (0,08) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,100 | 20.03.2024 | ¥ 6.090.000 | 443 | 0,04 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 18.03.2026 | 4.650.000 | (865) | (0,08) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,380 | 18.06.2028 | 90.000 | 19 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,683 | 27.11.2020 | MXN 269.700 | (177) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,700 | 02.11.2020 | 161.200 | 108 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,720 | 13.11.2020 | 274.900 | (209) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,747 | 06.11.2020 | 735.100 | 478 | 0,04 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,855 | 03.12.2020 | 329.700 | (262) | (0,02) |
| | | | | | $ (4.727) | (0,42) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (4.674)** | **(0,42)** |

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

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

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

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### DEVISENOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC USD versus MXN | MXN 19,600 | 03.07.2019 | 5.300 | $ (46) | $ (2) | 0,00 |
| HUS | Call - OTC USD versus MXN | 20,300 | 18.07.2019 | 6.500 | (54) | (4) | 0,00 |
| MYI | Call - OTC USD versus MXN | 19,800 | 10.07.2019 | 2.650 | (22) | (2) | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus MXN | 20,410 | 01.08.2019 | 4.800 | (48) | (6) | 0,00 |
| | | | | | $ (170) | $ (14) | 0,00 |

(1) 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 | 07/2019 | CAD 12.701 | $ 9.470 | $ 0 | $ (249) | $ (249) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ 15.668 | AUD 22.436 | 76 | 0 | 76 | 0,01 |
| | 07/2019 | 12.388 | CAD 16.564 | 289 | 0 | 289 | 0,03 |
| | 08/2019 | AUD 22.436 | $ 15.685 | 0 | (77) | (77) | (0,01) |
| | 08/2019 | € 608 | 690 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 6.685 | 8.479 | 0 | (29) | (29) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 129 | TRY 764 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | ARS 31.152 | `$ 698 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ 2.448 | 3.186 | 64 | 0 | 64 | 0,01 |
| | 08/2019 | $ 8.492 | £ 6.685 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 08/2019 | 5.677 | ¥ 618.100 | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | CAD 5.321 | $ 3.969 | 0 | (103) | (103) | (0,01) |
| CBK | 07/2019 | ARS 14.857 | 305 | 0 | (31) | (31) | 0,00 |
| | 07/2019 | AUD 22.436 | 15.532 | 0 | (212) | (212) | (0,02) |
| | 07/2019 | CAD 192 | 142 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 1.127 | CAD 1.493 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ 24.930 | $ 32.012 | 232 | (15) | 217 | 0,02 |
| | 08/2019 | ¥ 441.800 | 4.057 | 0 | (57) | (57) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ 576 | € 511 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08/2019 | 12.828 | £ 10.110 | 66 | 0 | 66 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | CAD 12.310 | $ 9.243 | 0 | (177) | (177) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ 713 | MXN 13.773 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | £ 4 | $ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 299 | ARS 14.857 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | 07/2019 | 5.926 | CAD 7.988 | 187 | 0 | 187 | 0,02 |
| | 07/2019 | 5.302 | € 4.663 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ 2 | $ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | $ 3.106 | CAD 4.163 | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| | 08/2019 | £ 4.157 | $ 5.328 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ 817.500 | 7.515 | 0 | (98) | (98) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ 11.477 | ¥ 1.233.400 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09/2019 | THB 3.921 | $ 124 | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | $ 4 | £ 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 8.461 | 6.685 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| TOR | 08/2019 | MXN 11.118 | $ 575 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 08/2019 | € 36.536 | 41.343 | 0 | (412) | (412) | (0,04) |
| | | | | $ 1.255 | $ (1.475) | $ (220) | (0,02) |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 35.311 | $ 40.127 | $ 0 | $ (85) | $ (85) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ 40.229 | € 35.311 | 85 | 0 | 85 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | € 34.564 | $ 39.300 | 0 | (62) | (62) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 85 | € 76 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | 39.400 | 34.564 | 63 | 0 | 63 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | 39.349 | 35.184 | 718 | 0 | 718 | 0,06 |
| CBK | 07/2019 | € 35.311 | $ 40.131 | 0 | (81) | (81) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 599 | € 529 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | 40.233 | 35.311 | 82 | 0 | 82 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | 97 | 85 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 39.342 | 35.184 | 725 | 0 | 725 | 0,06 |
| RBC | 07/2019 | 84 | 74 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | 597 | 528 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € 1.934 | $ 2.170 | 0 | (32) | (32) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 250 | € 220 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 127 | 114 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | 39.343 | 35.184 | 725 | 0 | 725 | 0,07 |
| | | | | $ 2.411 | $ (260) | $ 2.151 | 0,19 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | $ 3.071 | £ 2.431 | $ 23 | $ 0 | $ 23 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 25.200 | $ 31.963 | 0 | (109) | (109) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ 31.875 | £ 25.092 | 110 | 0 | 110 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | 27.788 | 21.862 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | £ 25.013 | $ 31.782 | 0 | (53) | (53) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 11.614 | £ 9.166 | 51 | 0 | 51 | 0,00 |
| | 08/2019 | 31.831 | 25.013 | 53 | 0 | 53 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | 167 | 132 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 1.173 | 928 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 11.547 | 9.123 | 64 | 0 | 64 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | 11.325 | 8.963 | 82 | 0 | 82 | 0,01 |
| UAG | 07/2019 | 27.788 | 21.862 | 35 | 0 | 35 | 0,00 |
| | | | | $ 462 | $ (162) | $ 300 | 0,03 |

Zum 30. Juni 2019 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | $ 0 | ILS 1 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 12 | 45 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 13 | 46 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | 13 | 46 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 2.218** | **0,20** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 132.545 | $ (136.959) | (12,28) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (136.959)** | **(12,28)** |
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Lloyds Bank Corporate Markets PLC** | | | |
| 3,092 % fällig am 26.10.2020 | 3.300 | 3.310 | 0,30 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 3.310** | **0,30** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 1.292.686** | **115,96** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (177.880)** | **(15,96)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 1.114.806** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Reines Kapitalwertpapier.**

**(c) Nullkuponwertpapier.**

**(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(e) Mit dem Fonds verbunden.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 240.429 als Sicherheiten verpfändet.**

**(g) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 28.846 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 1.214 als Sicherheiten erhalten.**

**Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 290 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 7.967 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 350 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 2.509 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | $ (2.563) | $ 2.509 | $ 2.509 | 0,23 |
| RDR | 2,550 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 5.600 | U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.05.2021 | (5.721) | 5.600 | 5.601 | 0,50 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (8.284)** | **$ 8.109** | **$ 8.110** | **0,73** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 109.947 | $ 1.314.895 | $ 0 | $ 1.424.842 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 3.310 | 0 | 3.310 |
| Finanzderivate[3] | 3.949 | (2.456) | 0 | 1.493 |
| Leerverkäufe | 0 | (136.959) | 0 | (136.959) |
| **Summen** | **$ 113.896** | **$ 1.178.790** | **$ 0** | **$ 1.292.686** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 110.857 | $ 1.551.560 | $ 5.008 | $ 1.667.425 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 3.301 | 0 | 3.301 |
| Finanzderivate[3] | (7.735) | (498) | 0 | (8.233) |
| Leerverkäufe | 0 | (31.712) | 0 | (31.712) |
| **Summen** | **$ 103.122** | **$ 1.522.651** | **$ 5.008** | **$ 1.630.781** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| IND | 2,600 % | 25.06.2019 | 25.07.2019 | $ (1.919) | $ (1.920) | (0,17) |
| | 2,650 | 13.06.2019 | 15.07.2019 | (168.281) | (168.504) | (15,12) |
| SCX | 2,590 | 14.05.2019 | 24.07.2019 | (47.895) | (48.060) | (4,31) |
| | 2,600 | 17.04.2019 | 17.07.2019 | (16.041) | (16.128) | (1,45) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (234.612)** | **(21,05)** |

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkaufgeschäfte[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPG | 2,580 % | 13.06.2019 | 25.07.2019 | $ (28.684) | $ (28.721) | (2,58) |
| **Summe Rückkaufgeschäfte** | | | | | **$ (28.721)** | **(2,58)** |

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 49 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 55 | $ 0 | $ 55 |
| BPS | 149 | 0 | 149 |
| BRC | 650 | (730) | (80) |
| CBK | 58 | (350) | (292) |
| GLM | (177) | 0 | (177) |
| HUS | 230 | 0 | 230 |
| JPM | 11 | 0 | 11 |
| MYI | 725 | (750) | (25) |
| RYL | 4 | (30) | (26) |
| SCX | 80 | (10) | 70 |
| SSB | 85 | 0 | 85 |
| TOR | 725 | (540) | 185 |
| UAG | (377) | 350 | (27) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 58,51 | 54,20 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 68,57 | 80,86 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,73 | 1,47 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,35 | (0,63) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,42) | (0,13) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,20 | 0,09 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (12,28) | (2,60) |
| Einlagenzertifikate | 0,30 | 0,27 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (21,05) | (17,41) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (2,58) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 44,57 | 54,41 |
| US-Regierungsbehörden | 40,08 | 51,73 |
| US-Schatzobligationen | 16,83 | 2,84 |
| Non-Agency-MBS | 5,23 | 4,00 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 8,36 | 9,46 |
| Staatsemissionen | 2,14 | 2,49 |
| Investmentfonds | 2,74 | 2,46 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 6,69 | 6,07 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,73 | 2,52 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,44 | 0,55 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,35 | (0,63) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Zinsswaps | (0,42) | (0,13) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Devisenterminkontrakte | (0,02) | 0,05 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,22 | 0,04 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (12,28) | (2,60) |
| Einlagenzertifikate | 0,30 | 0,27 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (15,96) | (33,53) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Altran Technologies S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 20.03.2025 | € | 1.321 | $ 1.510 | 0,29 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,410 % fällig am 07.09.2023 | $ | 170 | 170 | 0,03 |
| **Delos Finance SARL** | | | | |
| 4,080 % fällig am 06.10.2023 | | 500 | 500 | 0,10 |
| **Fortress Investment Group LLC** | | | | |
| 4,402 % fällig am 27.12.2022 | | 221 | 221 | 0,04 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,330 % fällig am 13.03.2025 | | 119 | 119 | 0,02 |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | | |
| 4,152 % fällig am 27.03.2025 | | 289 | 287 | 0,06 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics S.A.** | | | | |
| 5,680 % fällig am 30.06.2025 | | 95 | 91 | 0,02 |
| **RPI Finance Trust** | | | | |
| 4,402 % fällig am 27.03.2023 | | 94 | 94 | 0,02 |
| | | | 2.992 | 0,58 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € | 300 | 346 | 0,07 |
| **Aegon Bank NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2024 | | 2.300 | 2.640 | 0,51 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.02.2022 | $ | 500 | 515 | 0,10 |
| 4,250 % fällig am 01.07.2020 | | 200 | 203 | 0,04 |
| 4,450 % fällig am 16.12.2021 | | 1.400 | 1.454 | 0,28 |
| **AIA Group Ltd.** | | | | |
| 2,907 % fällig am 20.09.2021 | | 200 | 200 | 0,04 |
| **Air Lease Corp.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.01.2020 | | 255 | 254 | 0,05 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.06.2023 | | 1.200 | 1.259 | 0,24 |
| **Alleghany Corp.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2020 | | 400 | 415 | 0,08 |
| **Ambac LSNI LLC** | | | | |
| 7,319 % fällig am 12.02.2023 | | 89 | 91 | 0,02 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 5,900 % fällig am 01.11.2021 | | 300 | 323 | 0,06 |
| **Assurant, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 27.09.2023 | | 1.500 | 1.561 | 0,30 |
| **Athene Global Funding** | | | | |
| 3,732 % fällig am 20.04.2020 | | 1.800 | 1.809 | 0,35 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.10.2020 | | 2.200 | 2.328 | 0,45 |
| **Axis Bank Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 21.05.2020 | | 500 | 501 | 0,10 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 31.01.2023 | | 400 | 416 | 0,08 |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 3,380 % fällig am 25.07.2020 | | 1.200 | 1.203 | 0,23 |
| **Banco Santander Mexico S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.11.2022 | | 1.500 | 1.543 | 0,30 |
| **Banco Santander Mexico S.A.** | | | | |
| 25,500 % fällig am 17.07.2019 | ARS | 54.600 | 1.246 | 0,24 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 23.02.2023 | $ | 1.400 | 1.421 | 0,27 |
| **Bank Mandiri Persero Tbk PT** | | | | |
| 3,750 % fällig am 11.04.2024 | | 1.100 | 1.122 | 0,22 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 0,491 % fällig am 07.02.2022 | € | 2.400 | 2.752 | 0,53 |
| **Bank of New York Mellon Corp.** | | | | |
| 2,300 % fällig am 11.09.2019 | $ | 100 | 100 | 0,02 |
| 2,600 % fällig am 17.08.2020 | | 50 | 50 | 0,01 |
| **Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT** | | | | |
| 4,625 % fällig am 20.07.2023 | | 700 | 735 | 0,14 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 20.07.2023 | | 200 | 210 | 0,04 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (f) | $ | 1.200 | $ 1.311 | 0,25 |
| 10,179 % fällig am 12.06.2021 | | 1.000 | 1.132 | 0,22 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | £ | 1.650 | 2.103 | 0,41 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | | 3.300 | 4.326 | 0,83 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 10.04.2024 | $ | 200 | 209 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 10.03.2021 | | 2.500 | 2.634 | 0,51 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 27.05.2021 | | 1.100 | 1.137 | 0,22 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | |
| 1,400 % fällig am 06.07.2022 | € | 600 | 700 | 0,14 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | $ | 4.000 | 4.294 | 0,83 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.09.2021 | | 1.800 | 1.781 | 0,34 |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 800 | 799 | 0,15 |
| 3,500 % fällig am 10.10.2024 | | 1.000 | 1.017 | 0,20 |
| **Brixmor Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,629 % fällig am 01.02.2022 | | 1.700 | 1.701 | 0,33 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 01.02.2024 | € | 900 | 1.098 | 0,21 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 6,500 % fällig am 17.06.2022 | $ | 850 | 915 | 0,18 |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | | 4.000 | 4.052 | 0,78 |
| **Castellum AB** | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | € | 1.400 | 1.690 | 0,33 |
| **Cetin Finance BV** | | | | |
| 1,423 % fällig am 06.12.2021 | | 1.200 | 1.408 | 0,27 |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 6,250 % fällig am 28.06.2021 | $ | 900 | 866 | 0,17 |
| 7,000 % fällig am 23.03.2020 | | 900 | 910 | 0,18 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 3,123 % fällig am 20.05.2022 | | 2.500 | 2.504 | 0,48 |
| **CMHI Finance BVI Co. Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 06.08.2023 | | 1.100 | 1.160 | 0,22 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 6,875 % fällig am 19.03.2020 (f) | € | 1.000 | 1.195 | 0,23 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 09.03.2020 | $ | 900 | 918 | 0,18 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | € | 600 | 694 | 0,13 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 1.000 | 1.036 | 0,20 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,997 % fällig am 14.12.2023 | | 3.500 | 3.532 | 0,68 |
| 3,574 % fällig am 09.01.2023 | | 500 | 511 | 0,10 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 10.12.2020 | | 300 | 302 | 0,06 |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 850 | 882 | 0,17 |
| 3,800 % fällig am 09.06.2023 | | 400 | 415 | 0,08 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.02.2021 | | 1.300 | 1.318 | 0,25 |
| **Danske Bank A/S** | | | | |
| 3,496 % fällig am 12.09.2023 | | 2.100 | 2.041 | 0,39 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 3,150 % fällig am 22.01.2021 | | 2.500 | 2.482 | 0,48 |
| 3,567 % fällig am 13.07.2020 | | 3.700 | 3.677 | 0,71 |
| 3,855 % fällig am 04.02.2021 | | 500 | 496 | 0,10 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 2.000 | 2.028 | 0,39 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 24.06.2021 | € | 300 | 350 | 0,07 |
| **Flagstar Bancorp, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.07.2021 | $ | 600 | 633 | 0,12 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,006 % fällig am 02.11.2020 | | 1.900 | 1.882 | 0,36 |
| 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 400 | 483 | 0,09 |
| 3,273 % fällig am 24.09.2020 | $ | 2.800 | 2.798 | 0,54 |
| 3,365 % fällig am 12.08.2019 | | 200 | 200 | 0,04 |
| 3,408 % fällig am 05.04.2021 | | 700 | 691 | 0,13 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.03.2022 | | 100 | 104 | 0,02 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | |
| 10,750 % fällig am 01.04.2024 | | 1.400 | 1.309 | 0,25 |
| **GE Capital European Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 0,069 % fällig am 21.01.2020 | € | 600 | 684 | 0,13 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | $ | 2.000 | $ 1.991 | 0,38 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 31.07.2019 | £ | 1.000 | 1.276 | 0,25 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 08.07.2022 | $ | 500 | 509 | 0,10 |
| 3,640 % fällig am 30.06.2022 | | 100 | 100 | 0,02 |
| 5,100 % fällig am 17.01.2024 | | 600 | 642 | 0,12 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 0,132 % fällig am 16.12.2020 | € | 2.400 | 2.736 | 0,53 |
| 0,688 % fällig am 27.07.2021 | | 600 | 693 | 0,13 |
| **Groupe Bruxelles Lambert S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 19.06.2025 | | 1.700 | 2.021 | 0,39 |
| **Grupo Aval Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 26.09.2022 | $ | 700 | 726 | 0,14 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.05.2022 | | 500 | 506 | 0,10 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,950 % fällig am 18.05.2024 | | 3.000 | 3.140 | 0,61 |
| **HSBC USA, Inc.** | | | | |
| 2,350 % fällig am 05.03.2020 | | 200 | 200 | 0,04 |
| **ICICI Bank Ltd.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 16.11.2020 | | 1.900 | 1.972 | 0,38 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 0,240 % fällig am 12.10.2020 | € | 2.000 | 2.278 | 0,44 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 5,800 % fällig am 25.09.2023 | $ | 700 | 775 | 0,15 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 1,000 % fällig am 20.09.2023 | € | 2.000 | 2.352 | 0,45 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 8,625 % fällig am 15.01.2022 | $ | 200 | 228 | 0,04 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 3,125 % fällig am 14.07.2022 | | 1.600 | 1.584 | 0,31 |
| 3,375 % fällig am 12.01.2023 | | 1.300 | 1.296 | 0,25 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 29.10.2020 | | 500 | 501 | 0,10 |
| 2,776 % fällig am 25.04.2023 | | 5.000 | 5.051 | 0,97 |
| 3,003 % fällig am 09.03.2021 | | 400 | 401 | 0,08 |
| 3,482 % fällig am 23.07.2024 | | 700 | 703 | 0,14 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 30.06.2022 | £ | 1.400 | 1.825 | 0,35 |
| **Kilroy Realty LP** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.12.2024 | $ | 800 | 824 | 0,16 |
| **KSA Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,894 % fällig am 20.04.2022 | | 1.100 | 1.114 | 0,21 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 3,055 % fällig am 07.05.2021 | | 1.800 | 1.800 | 0,35 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 2,907 % fällig am 07.11.2023 | | 1.900 | 1.904 | 0,37 |
| 4,050 % fällig am 16.08.2023 | | 1.000 | 1.045 | 0,20 |
| **LoanCore Capital Markets LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.06.2020 | | 630 | 627 | 0,12 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 0,500 % fällig am 30.04.2021 | € | 1.700 | 1.953 | 0,38 |
| **Marsh & McLennan Cos., Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 29.12.2020 | $ | 200 | 203 | 0,04 |
| **Metropolitan Life Global Funding** | | | | |
| 0,375 % fällig am 09.04.2024 | € | 2.100 | 2.421 | 0,47 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,446 % fällig am 26.07.2023 | $ | 3.000 | 3.007 | 0,58 |
| **Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 3,406 % fällig am 28.02.2022 | | 2.300 | 2.349 | 0,45 |
| **Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 19.10.2020 | | 200 | 201 | 0,04 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 0,637 % fällig am 26.07.2024 | € | 2.800 | 3.224 | 0,62 |
| **MUFG Bank Ltd.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 26.02.2023 | $ | 1.450 | 1.487 | 0,29 |
| **Multibank, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 09.11.2022 | | 200 | 205 | 0,04 |
| **Nationale-Nederlanden Bank NV** | | | | |
| 0,375 % fällig am 31.05.2023 | € | 300 | 345 | 0,07 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,622 % fällig am 26.04.2023 | $ | 700 | 713 | 0,14 |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 800 | 817 | 0,16 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Natwest Markets PLC** | | | | | |
| 0,080 % fällig am 02.03.2020 | € | 2.500 | $ | 2.850 | 0,55 |
| **Navient Corp.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 25.03.2021 | $ | 25 | | 26 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 550 | | 571 | 0,11 |
| **NE Property BV** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.05.2023 | € | 300 | | 351 | 0,07 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | | | |
| 3,016 % fällig am 21.09.2021 | $ | 3.600 | | 3.600 | 0,69 |
| 3,487 % fällig am 13.01.2022 | | 900 | | 901 | 0,17 |
| **Protective Life Global Funding** | | | | | |
| 2,700 % fällig am 25.11.2020 | | 150 | | 151 | 0,03 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | | 1.100 | | 1.122 | 0,22 |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 3.900 | | 3.910 | 0,75 |
| **Reliance Standard Life Global Funding** | | | | | |
| 3,050 % fällig am 20.01.2021 | | 200 | | 202 | 0,04 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 08.03.2023 | € | 500 | | 588 | 0,11 |
| 3,498 % fällig am 15.05.2023 | $ | 900 | | 910 | 0,18 |
| 6,000 % fällig am 19.12.2023 | | 800 | | 872 | 0,17 |
| 6,400 % fällig am 21.10.2019 | | 100 | | 101 | 0,02 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 4,796 % fällig am 15.11.2024 | | 1.600 | | 1.701 | 0,33 |
| **Santander UK PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.03.2020 | | 100 | | 100 | 0,02 |
| 3,178 % fällig am 15.11.2021 | | 1.300 | | 1.304 | 0,25 |
| **SBA Tower Trust** | | | | | |
| 2,877 % fällig am 15.07.2046 | | 900 | | 903 | 0,17 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 2.500 | | 2.659 | 0,51 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | | |
| 5,700 % fällig am 27.02.2022 | | 700 | | 711 | 0,14 |
| 5,950 % fällig am 24.10.2022 | | 900 | | 915 | 0,18 |
| **SL Green Realty Corp.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.12.2022 | | 2.900 | | 3.046 | 0,59 |
| **SLM Corp.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 05.04.2022 | | 700 | | 696 | 0,13 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.07.2021 | | 1.400 | | 1.400 | 0,27 |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | | 1.200 | | 1.216 | 0,23 |
| 3,550 % fällig am 15.04.2024 | | 3.330 | | 3.429 | 0,66 |
| 4,125 % fällig am 15.07.2023 | | 800 | | 838 | 0,16 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 800 | | 861 | 0,17 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | | |
| 4,247 % fällig am 20.01.2023 | | 600 | | 620 | 0,12 |
| **State Bank of India** | | | | | |
| 3,539 % fällig am 06.04.2020 | | 2.800 | | 2.807 | 0,54 |
| **Stearns Holdings LLC** | | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.08.2020 | | 602 | | 575 | 0,11 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | | | |
| 1,950 % fällig am 19.09.2019 | | 1.600 | | 1.598 | 0,31 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.01.2021 | | 900 | | 932 | 0,18 |
| **Synchrony Financial** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.03.2024 | | 600 | | 629 | 0,12 |
| **TP ICAP PLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | £ | 1.750 | | 2.331 | 0,45 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 2,450 % fällig am 01.12.2020 | $ | 2.450 | | 2.454 | 0,47 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (f) | | 2.900 | | 3.254 | 0,63 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | | |
| 2,859 % fällig am 15.08.2023 | | 300 | | 303 | 0,06 |
| 2,950 % fällig am 24.09.2020 | | 500 | | 503 | 0,10 |
| 4,377 % fällig am 14.04.2021 | | 500 | | 512 | 0,10 |
| **UniCredit SpA** | | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 2.300 | | 2.629 | 0,51 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 23.12.2019 | | 1.708 | | 1.718 | 0,33 |
| 4,150 % fällig am 18.04.2023 | | 1.900 | | 1.953 | 0,38 |
| **VEREIT Operating Partnership LP** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | | 200 | | 205 | 0,04 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 01.04.2022 | € | 1.200 | | 1.379 | 0,27 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 07.09.2021 | £ | 1.300 | $ | 1.663 | 0,32 |
| **Voyager Aviation Holdings LLC** | | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.08.2021 | $ | 100 | | 102 | 0,02 |
| **Washington Prime Group LP** | | | | | |
| 3,850 % fällig am 01.04.2020 | | 327 | | 325 | 0,06 |
| 5,950 % fällig am 15.08.2024 | | 500 | | 476 | 0,09 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 3,465 % fällig am 11.02.2022 | | 100 | | 101 | 0,02 |
| 3,550 % fällig am 29.09.2025 | | 1.300 | | 1.359 | 0,26 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | | | |
| 2,897 % fällig am 27.05.2022 | | 1.100 | | 1.111 | 0,21 |
| 2,900 % fällig am 25.03.2020 | | 2.800 | | 2.803 | 0,54 |
| 3,092 % fällig am 23.07.2021 | | 1.400 | | 1.402 | 0,27 |
| 3,102 % fällig am 22.10.2021 | | 700 | | 701 | 0,14 |
| 3,141 % fällig am 27.05.2022 | | 600 | | 601 | 0,12 |
| 3,550 % fällig am 14.08.2023 | | 1.400 | | 1.462 | 0,28 |
| 3,625 % fällig am 22.10.2021 | | 700 | | 720 | 0,14 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | | | |
| 4,700 % fällig am 15.03.2021 | | 300 | | 309 | 0,06 |
| | | | | 224.321 | 43,30 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | | |
| **21Vianet Group, Inc.** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2021 | | 300 | | 309 | 0,06 |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 900 | | 1.048 | 0,20 |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.09.2021 | $ | 100 | | 100 | 0,02 |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.06.2029 | | 855 | | 896 | 0,17 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2022 | | 866 | | 895 | 0,17 |
| **ALROSA Finance S.A.** | | | | | |
| 4,650 % fällig am 09.04.2024 | | 400 | | 415 | 0,08 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2023 | € | 1.800 | | 2.115 | 0,41 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2019 | $ | 1.600 | | 1.608 | 0,31 |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 22.09.2024 | | 2.000 | | 2.028 | 0,39 |
| **Arrow Electronics, Inc.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2022 | | 1.580 | | 1.606 | 0,31 |
| **AutoNation, Inc.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.02.2020 | | 2.185 | | 2.217 | 0,43 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2021 | | 2.291 | | 2.345 | 0,45 |
| **Baidu, Inc.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 29.09.2023 | | 700 | | 726 | 0,14 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | | 1.900 | | 1.905 | 0,37 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | | |
| 3,420 % fällig am 15.12.2023 | | 937 | | 921 | 0,18 |
| **Bluescope Finance Americas LLC** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 25.05.2023 | | 2.900 | | 3.032 | 0,58 |
| **Brambles USA, Inc.** | | | | | |
| 5,350 % fällig am 01.04.2020 | | 1.000 | | 1.023 | 0,20 |
| **Bristol-Myers Squibb Co.** | | | | | |
| 2,905 % fällig am 16.05.2022 | | 1.200 | | 1.203 | 0,23 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2021 | | 1.300 | | 1.309 | 0,25 |
| 3,125 % fällig am 15.10.2022 | | 1.400 | | 1.409 | 0,27 |
| **Buzzi Unicem SpA** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 28.04.2023 | € | 400 | | 475 | 0,09 |
| **CA, Inc.** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.12.2019 | $ | 441 | | 445 | 0,09 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | | |
| 3,040 % fällig am 15.03.2021 | | 600 | | 599 | 0,12 |
| **Cenovus Energy, Inc.** | | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.09.2023 | | 1.500 | | 1.544 | 0,30 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,849 % fällig am 03.03.2022 | | 700 | | 708 | 0,14 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 400 | | 404 | 0,08 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 400 | | 420 | 0,08 |
| **China Mengniu Dairy Co. Ltd.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 07.08.2023 | $ | 600 | $ | 629 | 0,12 |
| **China Resources Gas Group Ltd.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 05.04.2022 | | 300 | | 314 | 0,06 |
| **Christian Dior SE** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 24.06.2021 | € | 600 | | 691 | 0,13 |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | | |
| 2,700 % fällig am 25.11.2019 | $ | 700 | | 701 | 0,13 |
| **Comcast Corp.** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.04.2024 | | 1.500 | | 1.593 | 0,31 |
| **Constellation Brands, Inc.** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 07.11.2022 | | 2.400 | | 2.410 | 0,46 |
| 3,218 % fällig am 15.11.2021 | | 1.800 | | 1.801 | 0,35 |
| **Continental Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 10.05.2021 | | 170 | | 173 | 0,03 |
| **CRH America, Inc.** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2021 | | 700 | | 732 | 0,14 |
| **CSN Resources S.A.** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 13.02.2023 | | 400 | | 423 | 0,08 |
| **CVS Health Corp.** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 09.03.2023 | | 300 | | 310 | 0,06 |
| **DAE Funding LLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2020 | | 700 | | 702 | 0,14 |
| 5,250 % fällig am 15.11.2021 | | 700 | | 729 | 0,14 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | | |
| 3,403 % fällig am 22.02.2022 | | 2.300 | | 2.315 | 0,45 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 2.300 | | 2.480 | 0,48 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.06.2021 | | 1.300 | | 1.367 | 0,26 |
| **Dongfeng Motor Hong Kong International Co. Ltd.** | | | | | |
| 1,150 % fällig am 23.10.2021 | € | 2.400 | | 2.789 | 0,54 |
| **DXC Technology Co.** | | | | | |
| 3,470 % fällig am 01.03.2021 | $ | 3.462 | | 3.462 | 0,67 |
| **Eastern Creation Investment Holdings Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.09.2020 | | 2.000 | | 2.002 | 0,39 |
| **Enable Oklahoma Intrastate Transmission LLC** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.03.2020 | | 2.425 | | 2.480 | 0,48 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 924 | | 924 | 0,18 |
| 3,110 % fällig am 15.06.2020 | | 1.800 | | 1.805 | 0,35 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | | 1.500 | | 1.542 | 0,30 |
| **Equifax, Inc.** | | | | | |
| 3,388 % fällig am 15.08.2021 | | 2.200 | | 2.195 | 0,42 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.10.2020 | | 3.320 | | 3.434 | 0,66 |
| **Eurofins Scientific SE** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 25.07.2024 | € | 600 | | 683 | 0,13 |
| **Flex Ltd.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.06.2025 | $ | 1.600 | | 1.660 | 0,32 |
| **Florida Gas Transmission Co. LLC** | | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.07.2020 | | 600 | | 616 | 0,12 |
| **Fortune Brands Home & Security, Inc.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 21.09.2023 | | 2.700 | | 2.844 | 0,55 |
| **Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 31.07.2019 | | 5.039 | | 5.049 | 0,97 |
| **GATX Corp.** | | | | | |
| 3,285 % fällig am 05.11.2021 | | 800 | | 797 | 0,15 |
| **Geely Automobile Holdings Ltd.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 25.01.2023 | | 200 | | 201 | 0,04 |
| **General Electric Co.** | | | | | |
| 4,650 % fällig am 17.10.2021 | | 1.000 | | 1.042 | 0,20 |
| **General Mills, Inc.** | | | | | |
| 3,141 % fällig am 16.04.2021 | | 500 | | 500 | 0,10 |
| **General Motors Co.** | | | | | |
| 3,365 % fällig am 07.08.2020 | | 100 | | 100 | 0,02 |
| **Glencore Funding LLC** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 12.03.2024 | | 700 | | 727 | 0,14 |
| **Harris Corp.** | | | | | |
| 2,700 % fällig am 27.04.2020 | | 50 | | 50 | 0,01 |
| **HCA, Inc.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2022 | | 500 | | 547 | 0,11 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2020 | | 400 | | 409 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Holcim U.S. Finance SARL & Cie SCS** | | | | |
| 6,000 % fällig am 30.12.2019 | $ | 3.248 | $ 3.293 | 0,64 |
| **Huntsman International LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.11.2022 | | 1.326 | 1.403 | 0,27 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 3,202 % fällig am 18.09.2020 | | 2.700 | 2.702 | 0,52 |
| 3,396 % fällig am 03.04.2020 | | 400 | 401 | 0,08 |
| **IHS Markit Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.11.2022 | | 300 | 319 | 0,06 |
| **Incitec Pivot Finance LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 10.12.2019 | | 1.500 | 1.520 | 0,29 |
| **International Business Machines Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2024 | | 1.300 | 1.336 | 0,26 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 25.09.2020 | | 2.800 | 2.829 | 0,55 |
| **JT International Financial Services BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.09.2023 | | 1.200 | 1.248 | 0,24 |
| **Kansas City Southern** | | | | |
| 2,350 % fällig am 15.05.2020 | | 300 | 299 | 0,06 |
| **Kinetic Concepts Inc.** | | | | |
| 12,500 % fällig am 01.11.2021 | | 100 | 110 | 0,02 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 3,115 % fällig am 10.02.2021 | | 1.600 | 1.597 | 0,31 |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 1.790 | 1.833 | 0,35 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 02.12.2019 | £ | 1.000 | 1.298 | 0,25 |
| **Martin Marietta Materials, Inc.** | | | | |
| 3,173 % fällig am 22.05.2020 | $ | 900 | 900 | 0,17 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | | 1.300 | 1.362 | 0,26 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | | |
| 3,922 % fällig am 01.06.2021 | | 2.400 | 2.444 | 0,47 |
| **Midcontinent Express Pipeline LLC** | | | | |
| 6,700 % fällig am 15.09.2019 | | 750 | 757 | 0,15 |
| **Newell Brands, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 01.04.2026 | | 1.300 | 1.293 | 0,25 |
| **Norfolk Southern Railway Co.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 15.06.2020 | | 1.000 | 1.070 | 0,21 |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | | 700 | 718 | 0,14 |
| **Owens Corning** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.12.2022 | | 1.500 | 1.562 | 0,30 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 23.09.2020 | | 200 | 204 | 0,04 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 3.400 | 3.598 | 0,69 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.07.2020 | | 750 | 754 | 0,14 |
| 3,450 % fällig am 01.07.2024 | | 1.500 | 1.547 | 0,30 |
| 3,650 % fällig am 29.07.2021 | | 2.500 | 2.557 | 0,49 |
| 4,125 % fällig am 01.08.2023 | | 1.200 | 1.263 | 0,24 |
| **Pernod Ricard S.A.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.01.2022 | | 300 | 314 | 0,06 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 2,500 % fällig am 21.08.2021 | € | 2.400 | 2.744 | 0,53 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.01.2021 | $ | 300 | 304 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 15.01.2020 | | 700 | 718 | 0,14 |
| **QVC, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 02.07.2022 | | 500 | 521 | 0,10 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2020 | | 900 | 919 | 0,18 |
| **Ryder System, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 01.06.2022 | | 300 | 304 | 0,06 |
| **Safran S.A.** | | | | |
| 0,227 % fällig am 28.06.2021 | € | 2.800 | 3.188 | 0,61 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | $ | 5.900 | 6.213 | 1,20 |
| **SEB S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.11.2022 | € | 100 | 121 | 0,02 |
| **Seven & i Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 17.09.2021 | $ | 3.400 | 3.475 | 0,67 |
| **Shire Acquisitions Investments Ireland DAC** | | | | |
| 1,900 % fällig am 23.09.2019 | | 800 | 799 | 0,15 |
| **Southern Co.** | | | | |
| 3,019 % fällig am 30.09.2020 | $ | 150 | $ 150 | 0,03 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.06.2026 | | 500 | 502 | 0,10 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 3,360 % fällig am 20.03.2023 | | 675 | 677 | 0,13 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.11.2024 | | 50 | 52 | 0,01 |
| **Suntory Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 29.09.2019 | | 600 | 600 | 0,12 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | | 3.900 | 3.928 | 0,76 |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | | 400 | 416 | 0,08 |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 200 | 209 | 0,04 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,985 % fällig am 19.01.2023 | | 1.900 | 1.916 | 0,37 |
| 3,280 % fällig am 11.04.2024 | | 200 | 204 | 0,04 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Co. BV** | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | | 2.600 | 2.512 | 0,48 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.04.2022 | € | 350 | 394 | 0,08 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2020 | $ | 1.575 | 1.596 | 0,31 |
| **Toyota Industries Corp.** | | | | |
| 3,110 % fällig am 12.03.2022 | | 1.900 | 1.934 | 0,37 |
| **Toyota Motor Corp.** | | | | |
| 2,157 % fällig am 02.07.2022 (b) | | 1.300 | 1.300 | 0,25 |
| **Tyson Foods, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 28.09.2023 | | 1.700 | 1.793 | 0,35 |
| **Ubisoft Entertainment S.A.** | | | | |
| 1,289 % fällig am 30.01.2023 | € | 1.700 | 1.968 | 0,38 |
| **UCB S.A.** | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.04.2022 | | 2.000 | 2.372 | 0,46 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | $ | 1.656 | 1.670 | 0,32 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.11.2021 | | 2.700 | 2.788 | 0,54 |
| **Wabtec Corp.** | | | | |
| 3,710 % fällig am 15.09.2021 | | 2.800 | 2.793 | 0,54 |
| **Walt Disney Co.** | | | | |
| 5,650 % fällig am 15.08.2020 | | 200 | 208 | 0,04 |
| **West Fraser Timber Co. Ltd.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.10.2024 | | 200 | 208 | 0,04 |
| **WestJet Airlines Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 16.06.2021 | | 700 | 704 | 0,14 |
| **Williams Cos., Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.09.2021 | | 385 | 427 | 0,08 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 10.05.2021 | | 500 | 515 | 0,10 |
| **Wyndham Destinations, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.03.2022 | | 900 | 916 | 0,18 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | | 2.000 | 2.010 | 0,39 |
| 4,500 % fällig am 29.04.2022 | | 613 | 625 | 0,12 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,169 % fällig am 19.03.2021 | | 3.400 | 3.398 | 0,66 |
| **Zoetis, Inc.** | | | | |
| 2,960 % fällig am 20.08.2021 | | 2.100 | 2.085 | 0,40 |
| | | | 185.640 | 35,83 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Alabama Power Co.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.10.2020 | | 279 | 283 | 0,05 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | | 5.800 | 5.831 | 1,13 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.10.2021 | | 605 | 626 | 0,12 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.12.2023 | | 600 | 643 | 0,12 |
| **British Transco International Finance BV** | | | | |
| 0,000 % fällig am 04.11.2021 (c) | | 450 | 424 | 0,08 |
| **Centrais Eletricas Brasileiras S.A.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 30.07.2019 | | 600 | 602 | 0,12 |
| **Duquesne Light Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,400 % fällig am 15.09.2020 | | 1.667 | 1.739 | 0,34 |
| **Edison International** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.04.2020 | $ | 450 | $ 448 | 0,09 |
| **Evergy, Inc.** | | | | |
| 5,292 % fällig am 15.06.2022 | | 505 | 540 | 0,10 |
| **Exelon Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.06.2020 | | 1.050 | 1.053 | 0,20 |
| 5,150 % fällig am 01.12.2020 | | 750 | 773 | 0,15 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.07.2022 | | 100 | 101 | 0,02 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.09.2022 | | 200 | 204 | 0,04 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 22.11.2024 | € | 500 | 593 | 0,11 |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | | 4.000 | 4.887 | 0,94 |
| 3,125 % fällig am 17.11.2023 | | 400 | 493 | 0,09 |
| 6,510 % fällig am 07.03.2022 | $ | 100 | 108 | 0,02 |
| **Iberdrola Finance Ireland DAC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 11.09.2019 | | 2.595 | 2.606 | 0,50 |
| **IPALCO Enterprises, Inc.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.07.2020 | | 1.895 | 1.907 | 0,37 |
| **Majapahit Holding BV** | | | | |
| 7,750 % fällig am 20.01.2020 | | 1.500 | 1.546 | 0,30 |
| **Mega Advance Investments Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 12.05.2021 | | 1.400 | 1.455 | 0,28 |
| **Metropolitan Edison Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.03.2023 | | 300 | 310 | 0,06 |
| **Midwest Connector Capital Co. LLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.04.2022 | | 1.300 | 1.332 | 0,26 |
| **Mississippi Power Co.** | | | | |
| 2,961 % fällig am 27.03.2020 | | 1.500 | 1.500 | 0,29 |
| **NGPL PipeCo LLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.08.2022 | | 1.000 | 1.035 | 0,20 |
| **Niagara Mohawk Power Corp.** | | | | |
| 4,881 % fällig am 15.08.2019 | | 800 | 802 | 0,15 |
| **Nippon Telegraph & Telephone Corp.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 26.02.2020 | | 400 | 400 | 0,08 |
| **Novatek OAO via Novatek Finance DAC** | | | | |
| 4,422 % fällig am 13.12.2022 | | 400 | 410 | 0,08 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.09.2023 | | 2.418 | 2.833 | 0,55 |
| **Pennsylvania Electric Co.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 01.04.2020 | | 1.700 | 1.730 | 0,33 |
| **Petronas Global Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,707 % fällig am 18.03.2020 | | 500 | 501 | 0,10 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.12.2019 | | 1.900 | 1.899 | 0,37 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2020 | | 1.100 | 1.116 | 0,22 |
| **PPL WEM Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.05.2021 | | 1.300 | 1.346 | 0,26 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 2,900 % fällig am 01.02.2023 | | 280 | 283 | 0,05 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 100 | 104 | 0,02 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | | 25 | 27 | 0,01 |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 1.100 | 1.171 | 0,23 |
| **State Grid Overseas Investment Ltd.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 04.05.2020 | | 300 | 300 | 0,06 |
| 3,750 % fällig am 02.05.2023 | | 1.300 | 1.356 | 0,26 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.10.2023 | | 300 | 305 | 0,06 |
| **Vistra Operations Co. LLC** | | | | |
| 3,550 % fällig am 15.07.2024 | | 2.000 | 2.014 | 0,39 |
| | | | 47.636 | 9,20 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 457.597 | 88,33 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 26.300 | 26.884 | 5,19 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)** | | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 | | 1.216 | 1.214 | 0,23 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | | 345 | 349 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 0,500 % fällig am 15.04.2024 (g) | $ | 6.281 | $ 6.361 | 1,23 |
| 0,625 % fällig am 15.04.2023 (g) | | 19.133 | 19.362 | 3,74 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | | 742 | 760 | 0,15 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | | 2.952 | 3.077 | 0,59 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 1,250 % fällig am 31.10.2021 | | 8.000 | 7.912 | 1,53 |
| 2,000 % fällig am 31.05.2024 (g) | | 3.700 | 3.744 | 0,72 |
| 2,250 % fällig am 15.04.2022 | | 12.200 | 12.373 | 2,39 |
| 2,375 % fällig am 15.03.2022 (g) | | 8.500 | 8.653 | 1,67 |
| 2,500 % fällig am 31.05.2020 (g) | | 46.800 | 47.010 | 9,07 |
| 2,625 % fällig am 15.05.2021 (g) | | 12.700 | 12.898 | 2,49 |
| | | | 123.713 | 23,88 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,500 % fällig am 25.09.2035 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,594 % fällig am 25.11.2034 | | 19 | 20 | 0,01 |
| 6,362 % fällig am 25.09.2034 | | 813 | 916 | 0,18 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,345 % fällig am 25.01.2047 | | 327 | 326 | 0,06 |
| 4,740 % fällig am 25.01.2033 | | 9 | 9 | 0,00 |
| | | | 1.276 | 0,25 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Driver Australia Trust** | | | | |
| 2,810 % fällig am 21.07.2026 | AUD | 468 | 328 | 0,06 |
| **IXIS Real Estate Capital Trust** | | | | |
| 3,034 % fällig am 25.02.2036 | $ | 702 | 707 | 0,14 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,714 % fällig am 25.12.2035 | $ | 799 | $ 796 | 0,15 |
| **SBA Tower Trust** | | | | |
| 2,898 % fällig am 15.10.2044 | | 100 | 100 | 0,02 |
| | | | 1.931 | 0,37 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | ARS | 5.768 | 133 | 0,03 |
| **Australia Government International Bond** | | | | |
| 1,750 % fällig am 21.11.2020 | AUD | 3.300 | 2.340 | 0,45 |
| 2,750 % fällig am 21.10.2019 | | 435 | 307 | 0,06 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | € | 900 | 1.109 | 0,21 |
| **Canada Government International Bond** | | | | |
| 0,750 % fällig am 01.09.2020 | CAD | 1.400 | 1.060 | 0,21 |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 3,875 % fällig am 02.10.2019 | $ | 400 | 401 | 0,08 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | | |
| 2,100 % fällig am 15.09.2021 (d) | € | 170 | 203 | 0,04 |
| **Korea National Oil Corp.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 08.10.2019 | AUD | 2.130 | 1.504 | 0,29 |
| **Province of Alberta** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.11.2021 | £ | 100 | 127 | 0,02 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 4,000 % fällig am 02.06.2021 | CAD | 2.600 | 2.077 | 0,40 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 4.300 | 4.515 | 0,87 |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 22.07.2020 | £ | 1.000 | $ 1.290 | 0,25 |
| | | | 15.066 | 2,91 |
| | | | **AKTIEN** | |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (e)** | | 5.163 | 60 | 0,01 |
| | | | **PARI (000S)** | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (h)** | | | | |
| | | | 1.115 | 0,22 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 1.115 | 0,22 |
| | | | **AKTIEN** | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)** | | 11.527 | 116 | 0,02 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 630.750** | **121,76** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09/2019 | 375 | $ 226 | 0,04 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 77 | 51 | 0,01 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09/2019 | 39 | (51) | (0,01) |
| | | | | $ 226 | 0,04 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | $ 126,500 | 26.07.2019 | 80 | $ (20) | $ (12) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 80 | (17) | (21) | (0,01) |
| | | | | $ (37) | $ (33) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 193** | **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 – SCHUTZKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Constellation Energy Group, Inc. | (1,000) % | 20.12.2020 | $ 450 | $ 7 | 0,00 |
| Dow Chemical Co. | (1,000) | 20.12.2020 | 100 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 7 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.12.2022 | $ 2.900 | $ 14 | 0,00 |
| Daimler AG | 1,000 | 20.12.2020 | € 500 | (1) | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 | 20.12.2021 | $ 400 | 1 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| International Lease Finance Corp. | 5,000 % | 20.12.2023 | $ 900 | $ 29 | 0,01 |
| Prudential Financial, Inc. | 1,000 | 20.12.2020 | 200 | 1 | 0,00 |
| Prudential Financial, Inc. | 1,000 | 20.06.2021 | 600 | 6 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2024 | € 1.100 | 6 | 0,00 |
| Ryder System, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | $ 1.100 | 24 | 0,01 |
| Sherwin-Williams Co. | 1,000 | 20.06.2022 | 700 | 4 | 0,00 |
| Sherwin-Williams Co. | 1,000 | 20.12.2022 | 1.600 | 1 | 0,00 |
| Simon Property Group LP | 1,000 | 20.06.2022 | 400 | 10 | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2024 | € 1.200 | 15 | 0,00 |
| | | | | $ 110 | 0,02 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Main 28 5-Year Index | (1,000) % | 20.12.2022 | € 13.400 | $ 33 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 4.800 | $ 38 | 0,01 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,880 % | 02.07.2019 | $ 1.900 | $ (8) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,940 | 02.07.2019 | 2.200 | (15) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 27.06.2024 | 1.900 | (17) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 28.06.2024 | 2.200 | (20) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,050 | 19.06.2024 | 1.900 | (23) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,060 | 21.06.2024 | 1.900 | (24) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,080 | 20.06.2024 | 1.900 | (26) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,080 | 26.06.2024 | 1.900 | (27) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,090 | 24.06.2024 | 1.900 | (27) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,100 | 18.06.2024 | 1.900 | (28) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,110 | 25.06.2024 | 1.900 | (29) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,160 | 12.06.2024 | 2.200 | (39) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,190 | 11.06.2024 | 2.000 | (38) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,200 | 05.06.2024 | 1.900 | (37) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,210 | 04.06.2024 | 1.900 | (38) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,210 | 12.06.2024 | 1.900 | (38) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,220 | 30.05.2024 | 1.900 | (38) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,220 | 10.06.2024 | 2.100 | (43) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,240 | 29.05.2024 | 2.000 | (42) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,240 | 31.05.2024 | 2.200 | (47) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 30.05.2024 | 1.900 | (41) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,270 | 06.06.2024 | 2.000 | (46) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 05.06.2024 | 2.000 | (48) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 17.05.2024 | 2.000 | (48) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 22.05.2024 | 2.300 | (56) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,320 | 21.05.2024 | 2.300 | (58) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,330 | 20.05.2024 | 2.300 | (59) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,410 | 11.04.2024 | 2.000 | (58) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,425 | 15.04.2024 | 3.000 | (89) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,435 | 10.04.2024 | 2.100 | (63) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,475 | 10.04.2024 | 2.100 | (67) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,480 | 02.04.2024 | 1.300 | (41) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,490 | 03.04.2024 | 2.200 | (71) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,510 | 08.04.2024 | 2.300 | (77) | (0,02) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | £ 3.200 | (76) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,250 | 19.09.2023 | HUF 1.604.100 | 88 | 0,02 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,380 | 18.06.2028 | ¥ 350.000 | (121) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,399 | 18.06.2028 | 350.000 | (120) | (0,02) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,850 | 17.04.2024 | MXN 74.800 | 90 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,910 | 18.04.2024 | 50.200 | 67 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,930 | 19.04.2024 | 37.700 | 48 | 0,01 |
| | | | | | $ (1.450) | (0,29) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (1.262)** | **(0,25)** |

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

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

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

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

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

## OPTIONSKAUF

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,107 % | 12.09.2019 | 25.000 | $ 118 | $ 682 | 0,13 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,940 | 18.02.2020 | 13.650 | 100 | 350 | 0,07 |
| DUB | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,258 | 18.09.2019 | 1.700 | 51 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 269 | $ 1.032 | 0,20 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 1.500 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.700 | (2) | 0 | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 | 21.08.2019 | 2.000 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 1.400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 3.700 | (5) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 1.400 | (2) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.500 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 5.320 | (9) | (2) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 | 21.08.2019 | 4.000 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 1.300 | (1) | 0 | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 18.09.2019 | 5.000 | (11) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 5.000 | (10) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 2.500 | (4) | (1) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 1.200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.400 | (2) | 0 | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 1.100 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,800 | 17.07.2019 | 1.900 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 2.200 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 1.700 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 2,900 | 17.06.2020 | 2.400 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 1.100 | (2) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 8.780 | (14) | (3) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 3,000 | 17.06.2020 | 2.600 | (3) | (1) | 0,00 |
| JLN | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 700 | (1) | 0 | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 1.900 | (3) | (1) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.100 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (94) | $ (17) | (0,01) |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,086 % | 18.02.2020 | 1.300 | $ (100) | $ (249) | (0,05) |
| DUB | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,940 | 18.09.2019 | 7.300 | (52) | 0 | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,790 | 11.07.2019 | 1.900 | (3) | (7) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,070 | 11.07.2019 | 1.900 | (3) | 0 | 0,00 |
| MYC | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,880 | 01.07.2019 | 2.200 | (3) | (13) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,160 | 01.07.2019 | 2.200 | (3) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (164) | $ (269) | (0,05) |

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

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (Forts.)

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Petroleos Mexicanos | 1,000 % | 20.09.2020 | $ 100 | $ (6) | $ 4 | $ (2) | 0,00 |
| HUS | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 400 | (6) | 6 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 700 | (11) | 8 | (3) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2022 | 300 | (27) | 27 | 0 | 0,00 |
| JPM | AP Moller - Maersk | 1,000 | 20.06.2022 | € 500 | (3) | 8 | 5 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | $ 100 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (10) | 8 | (2) | 0,00 |
| UAG | Avolon Holdings Ltd. | 5,000 | 01.07.2020 | 300 | 19 | (6) | 13 | 0,00 |
| | | | | | $ (46 ) | $ 57 | $ 11 | 0,00 |

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

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 4.411 | AUD | 6.316 | $ 21 | $ 0 | $ 21 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3.087 | CAD | 4.060 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 6.316 | $ | 4.415 | 0 | (22) | (22) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 4.060 | | 3.089 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € | 123 | | 138 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 892 | | 153 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 27 | ARS | 1.345 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 17.597 | £ | 13.874 | 60 | 0 | 60 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.133 | PLN | 4.238 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 153 | TRY | 887 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 13.874 | $ | 17.624 | 0 | (61) | (61) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 2.543 | BRL | 9.813 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.327 | RUB | 86.635 | 38 | 0 | 38 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 6.316 | $ | 4.372 | 0 | (60) | (60) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 2.082 | | 2.354 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.133 | ARS | 55.210 | 116 | 0 | 116 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 66.499 | € | 58.512 | 136 | 0 | 136 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 140 | PLN | 527 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 58.512 | $ | 66.668 | 0 | (135) | (135) | (0,03) |
| | 09/2019 | $ | 1.163 | COP | 3.927.023 | 55 | 0 | 55 | 0,01 |
| | 10/2019 | | 259 | MXN | 5.085 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 55.249 | $ | 61.656 | 0 | (1.261) | (1.261) | (0,24) |
| | 07/2019 | $ | 635 | € | 560 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 128 | HUF | 36.225 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 370 | MXN | 7.306 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.360 | IDR | 19.952.450 | 39 | 0 | 39 | 0,01 |
| | 10/2019 | MXN | 5.085 | $ | 252 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | ARS | 125.448 | | 2.528 | 0 | (309) | (309) | (0,06) |
| | 07/2019 | CAD | 4.060 | | 3.012 | 0 | (95) | (95) | (0,02) |
| | 07/2019 | € | 710 | | 807 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 17 | € | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | € | 2.149 | $ | 2.431 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 07/2019 | HUF | 67.804 | | 246 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 600 | € | 531 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.023 | £ | 1.591 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 780 | MXN | 15.275 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 13.122 | $ | 16.608 | 0 | (92) | (92) | (0,02) |
| | 07/2019 | TRY | 1.956 | | 329 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.245 | RUB | 82.588 | 62 | 0 | 62 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.273 | ZAR | 18.136 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | £ | 2.343 | $ | 2.960 | 0 | (21) | (21) | 0,00 |
| TOR | 08/2019 | $ | 504 | MXN | 9.745 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 605 | $ (2.129) | $ (1.524) | (0,29) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 83 | CHF | 84 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF | 75 | $ | 77 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 83 | CHF | 84 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 77 | | 75 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | 07/2019 | $ | 84 | CHF | 84 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 75 | $ | 77 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 77 | CHF | 75 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CHF | 29 | $ | 29 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 7 | $ 0 | $ 7 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 118.622 | $ | 134.802 | $ 0 | $ (285) | $ (285) | (0,06) |
| | 08/2019 | $ | 135.146 | € | 118.622 | 287 | 0 | 287 | 0,06 |
| BPS | 07/2019 | € | 117.107 | $ | 133.151 | 0 | (211) | (211) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 200 | € | 178 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 133.491 | | 117.107 | 212 | 0 | 212 | 0,04 |
| BRC | 07/2019 | | 132.657 | | 118.615 | 2.422 | 0 | 2.422 | 0,47 |
| CBK | 07/2019 | € | 122.115 | $ | 138.786 | 0 | (279) | (279) | (0,05) |
| | 07/2019 | $ | 616 | € | 546 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 135.158 | | 118.622 | 274 | 0 | 274 | 0,05 |
| MYI | 07/2019 | | 130.821 | | 116.993 | 2.410 | 0 | 2.410 | 0,47 |
| RYL | 07/2019 | € | 87 | $ | 98 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | $ | 1.567 | € | 1.396 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € | 104 | $ | 117 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ | 132.636 | € | 118.615 | 2.443 | 0 | 2.443 | 0,47 |
| | | | | | | $ 8.079 | $ (777) | $ 7.302 | 1,41 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional GBP (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 50 | £ | 40 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 1.707 | $ | 2.165 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 82 | £ | 65 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.169 | | 1.707 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | £ | 1.704 | $ | 2.165 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.107 | £ | 1.663 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 2.169 | | 1.704 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 14 | | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 2.105 | | 1.663 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 2.071 | | 1.639 | 15 | 0 | 15 | 0,01 |
| | | | | | | $ 48 | $ (11) | $ 37 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 117 | NOK | 1.023 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | NOK | 190.424 | $ | 22.382 | 47 | 0 | 47 | 0,01 |
| | 08/2019 | $ | 22.405 | NOK | 190.424 | 0 | (47) | (47) | (0,01) |
| CBK | 07/2019 | NOK | 190.039 | $ | 22.338 | 49 | 0 | 49 | 0,01 |
| | 08/2019 | $ | 22.361 | NOK | 190.039 | 0 | (48) | (48) | (0,01) |
| HUS | 07/2019 | | 21.240 | | 186.534 | 638 | 0 | 638 | 0,12 |
| MYI | 07/2019 | | 21.547 | | 188.371 | 546 | 0 | 546 | 0,11 |
| SCX | 07/2019 | | 21.651 | | 189.466 | 571 | 0 | 571 | 0,11 |
| | | | | | | $ 1.853 | $ (95) | $ 1.758 | 0,34 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 8.337** | **1,61** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 1.100 | $ (1.109) | (0,21) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (1.109)** | **(0,21)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 636.909** | **122,94** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (118.842)** | **(22,94)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 518.067** | **100,00** |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des 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**

**(a) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(c) Nullkuponwertpapier.**

**(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(e) Mit dem Fonds verbunden.**

**(f) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(g) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 96.493 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 263 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 4.198 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 1.210 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(h) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 1.115 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (1.138) | $ 1.115 | $ 1.115 | 0,22 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.138)** | **$ 1.115** | **$ 1.115** | **0,22** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 176 | $ 630.574 | $ 0 | $ 630.750 |
| Finanzderivate[3] | 193 | 7.063 | 12 | 7.268 |
| Leerverkäufe | 0 | (1.109) | 0 | (1.109) |
| **Summen** | **$ 369** | **$ 636.528** | **$ 12** | **$ 636.909** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 251 | $ 558.028 | $ 146 | $ 558.425 |
| Finanzderivate[3] | 232 | (535) | 15 | (288) |
| **Summen** | **$ 483** | **$ 557.493** | **$ 161** | **$ 558.137** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,450 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ (2.228) | $ (2.228) | (0,43) |
| | 2,700 | 17.06.2019 | 01.07.2019 | (40.401) | (40.444) | (7,81) |
| | 2,780 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | (1.107) | (1.107) | (0,21) |
| | 3,050 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | (5.528) | (5.529) | (1,07) |
| RCY | 2,610 | 11.06.2019 | 23.07.2019 | (47.182) | (47.250) | (9,12) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (96.558)** | **(18,64)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 789 | $ (730) | $ 59 |
| BPS | 54 | 0 | 54 |
| BRC | 2.420 | (2.200) | 220 |
| CBK | 109 | 0 | 109 |
| CKL | (5) | 0 | (5) |
| DUB | 0 | (30) | (30) |
| GLM | (1.223) | 1.210 | (13) |
| GST | (8) | 0 | (8) |
| HUS | 230 | (400) | (170) |
| JPM | 1 | 0 | 1 |
| MYC | (13) | (110) | (123) |
| MYI | 2.956 | (2.780) | 176 |
| RYL | (1) | 0 | (1) |
| SCX | 579 | (540) | 39 |
| SSB | (7) | 0 | (7) |
| TOR | 2.443 | (2.500) | (57) |
| UAG | 13 | (20) | (7) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 88,56 | 78,69 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 32,98 | 25,56 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,22 | 1,87 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,03 | 0,05 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,25) | (0,16) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,61 | 0,06 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,21) | 0,00 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (18,64) | (7,02) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0,00 | (0,51) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 0,58 | 0,67 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 88,33 | 85,59 |
| US-Regierungsbehörden | 5,19 | 0,57 |
| US-Schatzobligationen | 23,88 | 13,32 |
| Non-Agency-MBS | 0,25 | 0,25 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 0,37 | 0,42 |
| Staatsemissionen | 2,91 | 3,31 |
| Investmentfonds | 0,01 | 0,01 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,22 | 1,95 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,02 | 0,03 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,04 | 0,05 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | 0,00 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,02 | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,01 | 0,04 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,29) | (0,18) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoption | 0,20 | 0,09 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | (0,02) |
| Zinsswapoption | (0,05) | (0,10) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | (0,29) | 0,01 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,76 | 0,07 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,21) | 0,00 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (22,94) | (6,07) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Low Duration Income Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Advanz Pharma Corp.** | | | | |
| 7,911 % fällig am 06.09.2024 | $ | 197 | $ 189 | 0,05 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 6,394 % fällig am 14.08.2026 | | 199 | 195 | 0,05 |
| **Bausch Health Cos., Inc.** | | | | |
| 5,162 % fällig am 27.11.2025 | | 66 | 65 | 0,02 |
| **CommScope, Inc.** | | | | |
| 5,652 % fällig am 06.04.2026 | | 100 | 100 | 0,03 |
| **Diamond Resorts Corp.** | | | | |
| 6,152 % fällig am 02.09.2023 | | 299 | 283 | 0,07 |
| **Envision Healthcare Corp.** | | | | |
| 6,152 % fällig am 10.10.2025 | | 249 | 217 | 0,05 |
| **Financial & Risk U.S. Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,152 % fällig am 01.10.2025 | | 362 | 352 | 0,09 |
| **Forest City Enterprises, L.P.** | | | | |
| 6,402 % fällig am 07.12.2025 | | 100 | 100 | 0,03 |
| **Gray Television, Inc.** | | | | |
| 4,931 % fällig am 02.01.2026 | | 100 | 99 | 0,02 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 6,579 % fällig am 01.05.2026 | | 1.822 | 1.826 | 0,45 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 6,154 % fällig am 27.11.2023 | | 1.780 | 1.763 | 0,44 |
| **McDermott Technology Americas, Inc.** | | | | |
| 7,402 % fällig am 12.05.2025 | | 53 | 53 | 0,01 |
| **Messer Industrie GmbH** | | | | |
| 4,830 % fällig am 01.03.2026 | | 60 | 59 | 0,02 |
| **Neiman Marcus Group Ltd. LLC** | | | | |
| 7,972 % fällig am 25.10.2023 | | 767 | 673 | 0,17 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics S.A.** | | | | |
| 5,680 % fällig am 30.06.2025 | | 16 | 15 | 0,00 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| TBD % fällig am 22.02.2049 ^ | | 187 | 182 | 0,05 |
| **Panther BF Aggregator LP** | | | | |
| 5,902 % fällig am 30.04.2026 | | 40 | 40 | 0,01 |
| **Sequa Mezzanine Holdings LLC** | | | | |
| 7,560 % fällig am 28.11.2021 | | 2.014 | 1.974 | 0,49 |
| **Starfruit Finco BV** | | | | |
| 5,669 % fällig am 01.10.2025 | | 100 | 99 | 0,02 |
| **Syniverse Holdings, Inc.** | | | | |
| 7,401 % fällig am 09.03.2023 | | 94 | 87 | 0,02 |
| **U.S. Renal Care, Inc.** | | | | |
| TBD % fällig am 13.06.2026 | | 76 | 75 | 0,02 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,152 % fällig am 15.03.2024 | | 392 | 374 | 0,09 |
| **Westmoreland Coal Co.** | | | | |
| 12,500 % - 15,000 % fällig am 15.03.2029 | | 13 | 11 | 0,00 |
| **Westmoreland Mining Holdings LLC** | | | | |
| 10,660 % fällig am 15.03.2022 | | 6 | 7 | 0,00 |
| | | | 8.838 | 2,20 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 26.05.2022 | | 1.820 | 1.854 | 0,46 |
| 4,625 % fällig am 01.07.2022 | | 700 | 731 | 0,18 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2021 | | 550 | 577 | 0,14 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 4,263 % fällig am 10.04.2025 | | 300 | 309 | 0,08 |
| **Air Lease Corp.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.03.2021 | | 52 | 52 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 15.01.2022 | | 34 | 35 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 01.02.2022 | | 1.900 | 1.943 | 0,48 |
| 3,875 % fällig am 01.04.2021 | | 25 | 26 | 0,01 |
| **Aircastle Ltd.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.04.2020 | | 10 | 10 | 0,00 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 40 | 40 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 21.05.2024 | | 98 | 101 | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 1.800 | 1.822 | 0,45 |
| **Ambac LSNI LLC** | | | | |
| 7,319 % fällig am 12.02.2023 | $ | 760 | $ 775 | 0,19 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2022 | | 30 | 30 | 0,01 |
| 3,300 % fällig am 15.02.2021 | | 22 | 22 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 15.09.2021 | | 1.260 | 1.287 | 0,32 |
| **Ardonagh Midco PLC** | | | | |
| 8,375 % fällig am 15.07.2023 | £ | 260 | 305 | 0,08 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 400 | 433 | 0,11 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 100 | 123 | 0,03 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 20.01.2022 | $ | 96 | 97 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 01.05.2023 | | 670 | 692 | 0,17 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2023 | | 346 | 367 | 0,09 |
| 5,250 % fällig am 15.05.2024 | | 262 | 281 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | | 7 | 7 | 0,00 |
| **Banca Carige SpA** | | | | |
| 1,090 % fällig am 25.02.2021 | € | 700 | 800 | 0,20 |
| 1,389 % fällig am 25.10.2021 | | 1.100 | 1.267 | 0,32 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 2,000 % fällig am 29.01.2024 | | 200 | 235 | 0,06 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (f)(h) | | 200 | 234 | 0,06 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 2,999 % fällig am 25.06.2022 | $ | 32 | 32 | 0,01 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (f)(h) | € | 200 | 241 | 0,06 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (h) | $ | 1.900 | 2.076 | 0,52 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | £ | 200 | 260 | 0,06 |
| 3,932 % fällig am 07.05.2025 | $ | 600 | 611 | 0,15 |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | | 700 | 725 | 0,18 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | € | 200 | 231 | 0,06 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | £ | 200 | 257 | 0,06 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (f)(h) | € | 400 | 494 | 0,12 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (f)(h) | $ | 400 | 420 | 0,10 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | |
| 1,400 % fällig am 06.07.2022 | € | 100 | 117 | 0,03 |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | | 100 | 120 | 0,03 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | $ | 200 | 217 | 0,05 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.03.2020 (j) | | 1.750 | 1.754 | 0,44 |
| 3,458 % fällig am 26.09.2023 | | 200 | 201 | 0,05 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2024 | | 15 | 15 | 0,00 |
| **Castellum AB** | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | € | 100 | 121 | 0,03 |
| **CBL & Associates LP** | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.12.2026 | $ | 73 | 50 | 0,01 |
| **China Construction Bank Corp.** | | | | |
| 0,262 % fällig am 24.09.2021 | € | 200 | 228 | 0,06 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.03.2021 | $ | 232 | 237 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2023 | | 838 | 898 | 0,22 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (f)(h) | € | 1.600 | 2.021 | 0,50 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | | 100 | 116 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 200 | 207 | 0,05 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (h) | | 400 | 441 | 0,11 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (f)(h) | | 200 | 214 | 0,05 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,180 % fällig am 07.12.2020 | € | 200 | 225 | 0,06 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 400 | 459 | 0,11 |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | | 300 | 347 | 0,09 |
| 3,855 % fällig am 04.02.2021 | $ | 160 | 159 | 0,04 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 1.600 | 1.623 | 0,40 |
| 5,000 % fällig am 14.02.2022 | | 150 | 155 | 0,04 |
| **Digital Realty Trust LP** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.07.2029 | | 122 | 124 | 0,03 |
| 4,450 % fällig am 15.07.2028 | | 15 | 16 | 0,00 |
| **EPR Properties** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.12.2026 | $ | 12 | $ 13 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 15.04.2028 | | 34 | 37 | 0,01 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 362 | 364 | 0,09 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | € | 100 | 113 | 0,03 |
| 3,408 % fällig am 05.04.2021 | $ | 400 | 395 | 0,10 |
| 3,484 % fällig am 12.10.2021 | | 500 | 492 | 0,12 |
| 3,753 % fällig am 15.02.2023 | | 200 | 194 | 0,05 |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 | | 400 | 407 | 0,10 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 301 | 311 | 0,08 |
| 6,750 % fällig am 15.03.2022 | | 376 | 391 | 0,10 |
| **GE Capital European Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.05.2021 | € | 50 | 57 | 0,01 |
| 0,069 % fällig am 21.01.2020 | | 100 | 114 | 0,03 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 31.07.2019 | £ | 20 | 26 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 04.11.2020 | | 4 | 5 | 0,00 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 0,207 % fällig am 26.03.2022 | € | 100 | 112 | 0,03 |
| 3,200 % fällig am 13.07.2020 | $ | 20 | 20 | 0,01 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | | 96 | 104 | 0,03 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 09.06.2022 | | 25 | 25 | 0,01 |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** | | | | |
| 5,800 % fällig am 21.02.2022 | | 1.140 | 1.147 | 0,29 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.05.2022 | | 400 | 404 | 0,10 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,681 % fällig am 11.03.2025 | | 600 | 602 | 0,15 |
| **IMMOFINANZ AG** | | | | |
| 2,625 % fällig am 27.01.2023 | € | 200 | 238 | 0,06 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** | | | | |
| 3,310 % fällig am 08.11.2020 | $ | 1.100 | 1.102 | 0,27 |
| 3,400 % fällig am 29.11.2019 | | 500 | 501 | 0,12 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 3,320 % fällig am 02.10.2023 | | 200 | 200 | 0,05 |
| 4,100 % fällig am 02.10.2023 | | 200 | 211 | 0,05 |
| 4,550 % fällig am 02.10.2028 | | 200 | 220 | 0,06 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 8,625 % fällig am 15.01.2022 | | 25 | 29 | 0,01 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 03.06.2026 | | 334 | 338 | 0,08 |
| **John Deere Capital Corp.** | | | | |
| 2,769 % fällig am 07.01.2020 | | 25 | 25 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 3,012 % fällig am 18.06.2022 | | 25 | 25 | 0,01 |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 05.03.2024 (f)(h) | € | 200 | 242 | 0,06 |
| **Life Storage LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.06.2029 | $ | 14 | 14 | 0,00 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 2,907 % fällig am 07.11.2023 | | 1.200 | 1.203 | 0,30 |
| 3,900 % fällig am 12.03.2024 | | 200 | 208 | 0,05 |
| 4,050 % fällig am 16.08.2023 | | 200 | 209 | 0,05 |
| 4,550 % fällig am 16.08.2028 | | 200 | 216 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 27.09.2025 (f)(h) | | 400 | 421 | 0,10 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (f)(h) | £ | 650 | 940 | 0,23 |
| **LoanCore Capital Markets LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.06.2020 | $ | 600 | 597 | 0,15 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | € | 100 | 118 | 0,03 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | | 100 | 122 | 0,03 |
| **MPT Operating Partnership LP** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.08.2026 | $ | 260 | 272 | 0,07 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | |
| 0,080 % fällig am 02.03.2020 | € | 200 | 228 | 0,06 |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | | 100 | 114 | 0,03 |
| 0,625 % fällig am 02.03.2022 | | 400 | 458 | 0,11 |
| **NatWest Markets PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 29.09.2022 | $ | 700 | 716 | 0,18 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 26.07.2021 | | 725 | 769 | 0,19 |
| 7,250 % fällig am 25.01.2022 | | 500 | 541 | 0,13 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 310 | 322 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **NE Property BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.05.2023 | € | 100 | $ 117 | 0,03 |
| **Newmark Group, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.11.2023 | $ | 76 | 80 | 0,02 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | | 300 | 306 | 0,08 |
| 3,985 % fällig am 11.08.2021 | | 400 | 401 | 0,10 |
| 4,171 % fällig am 18.07.2021 | | 200 | 203 | 0,05 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | € | 100 | 118 | 0,03 |
| 3,125 % fällig am 28.03.2027 | £ | 100 | 130 | 0,03 |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | $ | 3.500 | 3.495 | 0,87 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 200 | 207 | 0,05 |
| **Sabra Health Care LP** | | | | |
| 4,800 % fällig am 01.06.2024 | | 18 | 19 | 0,00 |
| **Sagax AB** | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | € | 200 | 237 | 0,06 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 07.06.2024 | $ | 100 | 102 | 0,03 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 2,920 % fällig am 08.05.2026 | £ | 200 | 259 | 0,06 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (f)(h) | | 2.300 | 3.116 | 0,77 |
| **SBA Tower Trust** | | | | |
| 3,168 % fällig am 09.04.2047 | $ | 50 | 50 | 0,01 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 3.385 | 3.600 | 0,89 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.07.2021 | | 200 | 200 | 0,05 |
| 4,125 % fällig am 15.07.2023 | | 500 | 524 | 0,13 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (f)(h) | | 300 | 312 | 0,08 |
| **Spirit Realty LP** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.09.2026 | | 2.300 | 2.410 | 0,60 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.05.2022 | | 70 | 75 | 0,02 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 72 | 78 | 0,02 |
| 7,750 % fällig am 01.10.2021 | | 1.376 | 1.510 | 0,38 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 1.000 | 1.076 | 0,27 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.01.2022 | | 2.100 | 2.149 | 0,53 |
| **STORE Capital Corp.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.03.2029 | | 15 | 16 | 0,00 |
| **TLG Immobilien AG** | | | | |
| 1,500 % fällig am 28.05.2026 | € | 200 | 228 | 0,06 |
| **TP ICAP PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | £ | 100 | 130 | 0,03 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 1.100 | 1.257 | 0,31 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | £ | 323 | 462 | 0,12 |
| 7,395 % fällig am 28.03.2024 | | 70 | 101 | 0,03 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,625 % fällig am 08.09.2021 | € | 1.100 | 1.266 | 0,31 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | |
| 0,250 % fällig am 16.10.2020 | | 174 | 199 | 0,05 |
| 0,625 % fällig am 01.04.2022 | | 169 | 194 | 0,05 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 07.09.2021 | £ | 100 | 128 | 0,03 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 0,250 % fällig am 16.02.2021 | € | 110 | 126 | 0,03 |
| 0,500 % fällig am 20.06.2022 | | 28 | 32 | 0,01 |
| 1,000 % fällig am 16.02.2023 | | 18 | 21 | 0,01 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.07.2022 | $ | 13 | 13 | 0,00 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | | |
| 3,325 % fällig am 23.07.2021 | | 300 | 303 | 0,08 |
| **WP Carey, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.07.2029 | | 9 | 9 | 0,00 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | |
| 2,250 % fällig am 09.04.2026 | € | 100 | 122 | 0,03 |
| | | | 71.180 | 17,69 |

**INDUSTRIEWERTE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 31.07.2043 | £ | 1.700 | 2.065 | 0,51 |
| 4,249 % fällig am 31.07.2043 | | 510 | 660 | 0,16 |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 06.11.2022 | $ | 351 | $ 354 | 0,09 |
| 3,375 % fällig am 14.11.2021 | | 124 | 126 | 0,03 |
| **Adient U.S. LLC** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.05.2026 | | 11 | 11 | 0,00 |
| **Allied Universal Holdco LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.07.2026 (b) | | 38 | 39 | 0,01 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2023 | € | 2.960 | 3.478 | 0,86 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 01.02.2027 | $ | 1.700 | 1.789 | 0,44 |
| **Altria Group, Inc.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.02.2023 | € | 490 | 571 | 0,14 |
| **Arrow Electronics, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2022 | $ | 1.700 | 1.728 | 0,43 |
| **Avon International Capital PLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.08.2022 (b) | | 20 | 20 | 0,01 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 2,297 % fällig am 14.08.2020 | | 54 | 54 | 0,01 |
| 2,764 % fällig am 15.08.2022 | | 1.674 | 1.677 | 0,42 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | | 54 | 54 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 07.06.2022 | | 26 | 26 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2022 | | 26 | 27 | 0,01 |
| **Bausch Health Americas, Inc.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 31.01.2027 | | 24 | 26 | 0,01 |
| **Bausch Health Cos., Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.01.2028 | | 16 | 17 | 0,00 |
| 7,250 % fällig am 30.05.2029 | | 32 | 33 | 0,01 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.07.2021 | | 20 | 20 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 25.06.2021 | | 900 | 913 | 0,23 |
| **BCPE Cycle Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 10,625 % fällig am 15.07.2027 | | 46 | 47 | 0,01 |
| **Berry Global Escrow Corp.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2026 | | 74 | 76 | 0,02 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.04.2027 | | 128 | 128 | 0,03 |
| **Broadcom Corp.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 15.01.2021 | | 25 | 25 | 0,01 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2022 | | 1.748 | 1.753 | 0,44 |
| 3,625 % fällig am 15.01.2024 | | 8 | 8 | 0,00 |
| 3,875 % fällig am 15.01.2027 | | 25 | 25 | 0,01 |
| **Builders FirstSource, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.06.2027 | | 15 | 16 | 0,00 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,040 % fällig am 15.03.2021 | | 62 | 62 | 0,02 |
| **Canadian Natural Resources Ltd.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.11.2021 | | 1.777 | 1.816 | 0,45 |
| **Catalent Pharma Solutions, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2027 | | 6 | 6 | 0,00 |
| **CB IDEARC, Inc.** | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.09.2022 | | 22 | 0 | 0,00 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 25 | 25 | 0,01 |
| 4,229 % fällig am 01.02.2024 | | 696 | 699 | 0,17 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 1.015 | 1.067 | 0,27 |
| **Cigna Corp.** | | | | |
| 3,487 % fällig am 15.07.2023 | | 192 | 192 | 0,05 |
| **Clear Channel Communication, Inc.** | | | | |
| 11,250 % fällig am 01.03.2021 | | 23 | 0 | 0,00 |
| **Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2022 | | 986 | 1.013 | 0,25 |
| 9,250 % fällig am 15.02.2024 | | 357 | 388 | 0,10 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2021 | | 1.983 | 1.946 | 0,48 |
| 6,250 % fällig am 31.03.2023 | | 678 | 655 | 0,16 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2026 | | 342 | 330 | 0,08 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2024 | | 232 | 233 | 0,06 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.09.2022 | | 1.200 | 1.211 | 0,30 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2022 | | 1.700 | 1.771 | 0,44 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2020 | | 441 | 442 | 0,11 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2022 | | 119 | 121 | 0,03 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | $ | 1.484 | $ 1.549 | 0,38 |
| 5,250 % fällig am 15.11.2021 | | 222 | 231 | 0,06 |
| 5,750 % fällig am 15.11.2023 | | 228 | 240 | 0,06 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 25 | 26 | 0,01 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 04.12.2020 | | 1.600 | 1.599 | 0,40 |
| 3,625 % fällig am 15.03.2022 | | 25 | 25 | 0,01 |
| **Diamond Resorts International, Inc.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | | 273 | 282 | 0,07 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.06.2020 | | 1.800 | 1.804 | 0,45 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | | 2.046 | 2.061 | 0,51 |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 100 | 101 | 0,03 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | | 25 | 25 | 0,01 |
| **DP World PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.09.2026 | € | 100 | 119 | 0,03 |
| **Eagle Holding Co. LLC (7,750 % bar oder 7,750 % PIK)** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 (c) | $ | 19 | 19 | 0,00 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 05.06.2020 | | 10 | 10 | 0,00 |
| 2,600 % fällig am 15.07.2022 | | 938 | 940 | 0,23 |
| 3,800 % fällig am 09.03.2022 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 1.845 | 1.835 | 0,46 |
| **Enable Oklahoma Intrastate Transmission LLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.03.2020 | | 25 | 26 | 0,01 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 5,200 % fällig am 01.02.2022 | | 50 | 53 | 0,01 |
| **Equifax, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 15.08.2021 | | 1.800 | 1.835 | 0,46 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | |
| 2,600 % fällig am 01.12.2021 | | 20 | 20 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 01.10.2020 | | 25 | 26 | 0,01 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.07.2024 | | 135 | 136 | 0,03 |
| 3,200 % fällig am 01.07.2026 | | 87 | 89 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2029 | | 91 | 94 | 0,02 |
| 4,400 % fällig am 01.07.2049 | | 42 | 44 | 0,01 |
| **Flex Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.06.2029 | | 48 | 49 | 0,01 |
| **Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.02.2021 | | 22 | 23 | 0,01 |
| **GATX Corp.** | | | | |
| 4,850 % fällig am 01.06.2021 | | 10 | 10 | 0,00 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 09.01.2020 | | 5 | 5 | 0,00 |
| 3,100 % fällig am 09.01.2023 | | 83 | 84 | 0,02 |
| 3,150 % fällig am 07.09.2022 | | 2 | 2 | 0,00 |
| 5,550 % fällig am 04.05.2020 | | 13 | 13 | 0,00 |
| 5,550 % fällig am 05.01.2026 | | 164 | 183 | 0,05 |
| 6,150 % fällig am 07.08.2037 | | 46 | 54 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 10.01.2039 | | 29 | 36 | 0,01 |
| **Go Daddy Operating Co. LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2027 | | 28 | 29 | 0,01 |
| **GrubHub Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.07.2027 | | 12 | 12 | 0,00 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2023 | | 490 | 522 | 0,13 |
| **Hewlett Packard Enterprise Co.** | | | | |
| 3,318 % fällig am 05.10.2021 | | 1.200 | 1.200 | 0,30 |
| 3,500 % fällig am 05.10.2021 | | 600 | 615 | 0,15 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2030 | | 64 | 66 | 0,02 |
| **Holcim U.S. Finance SARL & Cie SCS** | | | | |
| 6,000 % fällig am 30.12.2019 | | 900 | 913 | 0,23 |
| **Huntsman International LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.05.2029 | | 23 | 24 | 0,01 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 3,202 % fällig am 18.09.2020 | | 98 | 98 | 0,02 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.05.2026 | | 416 | 444 | 0,11 |
| 8,375 % fällig am 01.05.2027 | | 755 | 794 | 0,20 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c) | € | 100 | 117 | 0,03 |

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

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % bar oder 4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (c) | € | 100 | $ 116 | 0,03 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar oder 6,750 % PIK)** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2027 (c) | $ | 112 | 113 | 0,03 |
| **IHS Markit Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.03.2026 | | 70 | 72 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 01.11.2022 | | 200 | 213 | 0,05 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 12.02.2027 | € | 100 | 119 | 0,03 |
| **Incitec Pivot Finance LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 10.12.2019 | $ | 10 | 10 | 0,00 |
| **Intelsat Connect Finance S.A.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 15.02.2023 | | 100 | 89 | 0,02 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.02.2024 | | 249 | 260 | 0,06 |
| 8,500 % fällig am 15.10.2024 | | 401 | 399 | 0,10 |
| 9,750 % fällig am 15.07.2025 | | 100 | 103 | 0,03 |
| **Intelsat Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.06.2021 ^ | | 3 | 3 | 0,00 |
| **International Flavors & Fragrances, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 25.09.2020 | | 50 | 51 | 0,01 |
| **Interpublic Group of Cos., Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2022 | | 18 | 19 | 0,00 |
| **Japan Tobacco, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 13.04.2021 | | 1.800 | 1.785 | 0,44 |
| **JT International Financial Services BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.09.2023 | | 1.600 | 1.663 | 0,41 |
| **Keurig Dr Pepper, Inc.** | | | | |
| 3,551 % fällig am 25.05.2021 | | 25 | 26 | 0,01 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | | |
| 2,118 % fällig am 11.09.2020 | | 1.800 | 1.792 | 0,45 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 02.07.2020 | | 40 | 40 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 2.425 | 2.483 | 0,62 |
| **Marathon Oil Corp.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.06.2020 | | 1.750 | 1.752 | 0,44 |
| 2,800 % fällig am 01.11.2022 | | 46 | 46 | 0,01 |
| **Masco Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2021 | | 30 | 30 | 0,01 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | | 25 | 26 | 0,01 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | |
| 5,327 % fällig am 06.02.2029 | | 70 | 74 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 01.02.2025 | | 21 | 22 | 0,01 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | £ | 45 | 65 | 0,02 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.10.2021 | $ | 3.621 | 3.589 | 0,89 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | € | 244 | 302 | 0,08 |
| 4,625 % fällig am 15.05.2029 | | 100 | 130 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | $ | 53 | 56 | 0,01 |
| **Norbord, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.07.2027 | | 20 | 20 | 0,00 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 21.07.2021 | | 850 | 843 | 0,21 |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | | 500 | 513 | 0,13 |
| 4,300 % fällig am 18.06.2029 | | 100 | 103 | 0,03 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2022 | | 133 | 128 | 0,03 |
| **Outfront Media Capital LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2027 | | 39 | 40 | 0,01 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 23.09.2020 | | 20 | 20 | 0,00 |
| **Par Pharmaceutical, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.04.2027 | | 77 | 76 | 0,02 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 18 | 19 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 287 | 304 | 0,08 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | | 19 | 21 | 0,01 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.02.2022 | | 35 | 36 | 0,01 |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | | 220 | 35 | 0,01 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 5,500 % fällig am 21.01.2021 | $ | 210 | $ 213 | 0,05 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.12.2029 (b) | | 22 | 22 | 0,01 |
| **QVC, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2023 | | 71 | 72 | 0,02 |
| 4,450 % fällig am 15.02.2025 | | 355 | 358 | 0,09 |
| 4,850 % fällig am 01.04.2024 | | 118 | 122 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 02.07.2022 | | 114 | 119 | 0,03 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.06.2022 | | 1.400 | 1.399 | 0,35 |
| **Refinitiv U.S. Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2026 | € | 970 | 1.133 | 0,28 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.06.2022 | $ | 50 | 52 | 0,01 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 1.666 | 1.731 | 0,43 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | | 200 | 211 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 200 | 215 | 0,05 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | | 200 | 218 | 0,05 |
| **Sirius XM Radio, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 36 | 37 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2029 | | 50 | 51 | 0,01 |
| **SoftBank Group Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 20.04.2023 | € | 1.300 | 1.611 | 0,40 |
| **Southern Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | $ | 12 | 12 | 0,00 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 5,152 % fällig am 20.09.2029 | | 400 | 413 | 0,10 |
| **Staples, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2026 | | 82 | 82 | 0,02 |
| 10,750 % fällig am 15.04.2027 | | 40 | 40 | 0,01 |
| **Sunoco Logistics Partners Operations LP** | | | | |
| 4,650 % fällig am 15.02.2022 | | 500 | 525 | 0,13 |
| **Suntory Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 28.06.2022 | | 1.700 | 1.700 | 0,42 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | | 200 | 201 | 0,05 |
| 3,933 % fällig am 23.04.2021 | | 1.800 | 1.833 | 0,46 |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 570 | 593 | 0,15 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | | |
| 5,462 % fällig am 16.02.2021 | | 400 | 419 | 0,10 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,700 % fällig am 19.07.2019 | | 10 | 10 | 0,00 |
| 2,200 % fällig am 21.07.2021 | | 4.213 | 4.013 | 1,00 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.02.2022 | | 26 | 27 | 0,01 |
| **Topaz Solar Farms LLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.09.2039 | | 47 | 47 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 30.09.2039 | | 249 | 263 | 0,07 |
| **Triumph Group, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.04.2021 | | 70 | 69 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 01.06.2022 | | 12 | 12 | 0,00 |
| **Tyson Foods, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 23.08.2021 | | 25 | 25 | 0,01 |
| **United Technologies Corp.** | | | | |
| 3,175 % fällig am 16.08.2021 | | 42 | 42 | 0,01 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2023 | | 713 | 701 | 0,17 |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | | 220 | 210 | 0,05 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.08.2026 | | 108 | 123 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 21.11.2036 | | 34 | 41 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 10.11.2039 | | 27 | 33 | 0,01 |
| **ViaSat, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2027 | | 37 | 39 | 0,01 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | | 50 | 50 | 0,01 |
| **Wabtec Corp.** | | | | |
| 3,710 % fällig am 15.09.2021 | | 500 | 499 | 0,12 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 04.03.2029 | | 114 | 121 | 0,03 |
| **Wyndham Destinations, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.03.2023 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 01.03.2022 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 5,400 % fällig am 01.04.2024 | $ | 6 | $ 6 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 01.04.2027 | | 42 | 44 | 0,01 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | | 2.345 | 2.357 | 0,59 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,169 % fällig am 19.03.2021 | | 10 | 10 | 0,00 |
| | | | 85.969 | 21,36 |

**VERSORGUNGSUNTERNEHMEN**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **American Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 2,150 % fällig am 13.11.2020 | | 20 | 20 | 0,01 |
| **China Shenhua Overseas Capital Co. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 20.01.2020 | | 700 | 701 | 0,17 |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 2,701 % fällig am 16.03.2020 | | 1.650 | 1.652 | 0,41 |
| **Edison International** | | | | |
| 2,400 % fällig am 15.09.2022 | | 28 | 27 | 0,01 |
| 2,950 % fällig am 15.03.2023 | | 4 | 4 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 15.06.2027 | | 24 | 26 | 0,01 |
| **Entergy Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.09.2020 | | 25 | 26 | 0,01 |
| **Exelon Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.06.2020 | | 25 | 25 | 0,01 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 15.07.2022 | | 25 | 25 | 0,01 |
| **Frontier Communications Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.04.2027 | | 70 | 73 | 0,02 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | € | 2.500 | 3.054 | 0,76 |
| **LG&E & KU Energy LLC** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.11.2020 | $ | 25 | 25 | 0,01 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | | 16 | 16 | 0,00 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 | | 6 | 6 | 0,00 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.02.2022 | | 20 | 21 | 0,01 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | | |
| 2,450 % fällig am 15.08.2022 ^ | | 286 | 276 | 0,07 |
| 2,950 % fällig am 01.03.2026 ^ | | 1.297 | 1.222 | 0,30 |
| 3,250 % fällig am 15.09.2021 ^ | | 131 | 128 | 0,03 |
| 3,250 % fällig am 15.06.2023 ^ | | 327 | 319 | 0,08 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 ^ | | 120 | 115 | 0,03 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | | 200 | 195 | 0,05 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2020 ^ | | 235 | 230 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ | | 242 | 234 | 0,06 |
| 3,750 % fällig am 15.02.2024 ^ | | 232 | 229 | 0,06 |
| 3,750 % fällig am 15.08.2042 ^ | | 12 | 11 | 0,00 |
| 3,850 % fällig am 15.11.2023 ^ | | 57 | 56 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2046 ^ | | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2021 ^ | | 93 | 92 | 0,02 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045 ^ | | 61 | 59 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.12.2041 ^ | | 10 | 10 | 0,00 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2043 ^ | | 10 | 10 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 15.02.2044 ^ | | 39 | 40 | 0,01 |
| 5,125 % fällig am 15.11.2043 ^ | | 95 | 98 | 0,02 |
| 5,400 % fällig am 15.01.2040 ^ | | 12 | 13 | 0,00 |
| 5,800 % fällig am 01.03.2037 ^ | | 53 | 58 | 0,01 |
| 6,050 % fällig am 01.03.2034 ^ | | 34 | 38 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 01.03.2039 ^ | | 62 | 70 | 0,02 |
| 6,350 % fällig am 15.02.2038 ^ | | 22 | 25 | 0,01 |
| **Pennsylvania Electric Co.** | | | | |
| 5,200 % fällig am 01.04.2020 | | 1.700 | 1.730 | 0,43 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.02.2029 | | 156 | 163 | 0,04 |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 220 | 236 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 17.03.2024 | | 400 | 439 | 0,11 |
| 8,750 % fällig am 23.05.2026 | | 1.346 | 1.665 | 0,41 |
| **Public Service Enterprise Group, Inc.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.11.2022 | | 124 | 124 | 0,03 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.06.2047 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **Sempra Energy** | | | | |
| 2,400 % fällig am 15.03.2020 | | 20 | 20 | 0,01 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.04.2035 | | 4 | 5 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2034 | | 2 | 2 | 0,00 |
| 6,650 % fällig am 01.04.2029 | | 15 | 17 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Southern California Gas Co.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.11.2040 | $ | 2 | $ 2 | 0,00 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | | 108 | 113 | 0,03 |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 1.600 | 1.662 | 0,41 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 222 | 236 | 0,06 |
| **Talen Energy Supply LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 18 | 18 | 0,00 |
| | | | 15.665 | 3,89 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 172.814 | 42,94 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae UMBS** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.11.2047 | | 460 | 474 | 0,12 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 46.100 | 47.126 | 11,71 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | | 64.800 | 66.958 | 16,63 |
| | | | 114.558 | 28,46 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.05.2049 | | 5.200 | 5.579 | 1,39 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | | |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | | 3.054 | 3.183 | 0,79 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | | 2.327 | 2.451 | 0,61 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 | | 4.300 | 4.444 | 1,10 |
| | | | 15.657 | 3,89 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Ashford Hospitality Trust** | | | | |
| 3,694 % fällig am 15.05.2035 | | 100 | 100 | 0,03 |
| 3,994 % fällig am 15.05.2035 | | 100 | 100 | 0,03 |
| 5,144 % fällig am 15.05.2035 | | 100 | 100 | 0,03 |
| **Atrium Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 3,324 % fällig am 15.12.2036 | | 2.450 | 2.452 | 0,61 |
| 3,824 % fällig am 15.06.2035 | | 50 | 50 | 0,01 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 4,153 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 4.094 | 2.828 | 0,70 |
| **ChaseFlex Trust** | | | | |
| 2,744 % fällig am 25.05.2037 | | 35 | 33 | 0,01 |
| **Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates** | | | | |
| 2,917 % fällig am 25.08.2035 | | 2.778 | 1.975 | 0,49 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 | | 86 | 88 | 0,02 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.03.2036 | | 88 | 75 | 0,02 |
| 4,135 % fällig am 25.08.2035 | | 2.862 | 2.704 | 0,67 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 | | 3.508 | 2.262 | 0,56 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,580 % fällig am 19.09.2037 | | 3.184 | 3.097 | 0,77 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 2,944 % fällig am 25.10.2035 | | 100 | 96 | 0,02 |
| **InTown Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 3,094 % fällig am 15.01.2033 | | 480 | 480 | 0,12 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 3,554 % fällig am 25.12.2037 | | 3.025 | 2.865 | 0,71 |
| **Renoir CDO BV** | | | | |
| 0,540 % fällig am 07.10.2095 | € | 615 | 703 | 0,18 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.08.2037 | $ | 965 | 922 | 0,23 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 6,609 % fällig am 25.02.2037 | | 12.168 | 6.249 | 1,55 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | |
| 6,250 % fällig am 25.08.2036 | | 2.219 | 2.147 | 0,53 |
| **Taurus FR DAC** | | | | |
| 1,000 % fällig am 02.02.2031 | € | 3.300 | 3.756 | 0,93 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | | |
| 5,965 % fällig am 25.07.2037 | $ | 159 | 86 | 0,02 |
| **Tharaldson Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 3,169 % fällig am 11.11.2034 | | 227 | 227 | 0,06 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 4,178 % fällig am 25.12.2042 | $ | 283 | $ 286 | 0,07 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 6.750 | 8.624 | 2,14 |
| **Trinidad Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,622 % fällig am 24.01.2059 | | 67 | 85 | 0,02 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,668 % fällig am 12.09.2050 | | 3.428 | 4.355 | 1,08 |
| **Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,438 % fällig am 15.11.2048 | $ | 302 | 305 | 0,08 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,784 % fällig am 25.01.2045 | | 274 | 273 | 0,07 |
| 3,961 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.510 | 1.490 | 0,37 |
| | | | 48.813 | 12,13 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 4,354 % fällig am 25.06.2034 | | 510 | 517 | 0,13 |
| **American Credit Acceptance Receivables Trust** | | | | |
| 2,920 % fällig am 12.08.2021 | | 305 | 306 | 0,08 |
| **Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,914 % fällig am 25.10.2035 | | 100 | 96 | 0,02 |
| **Aurium CLO DAC** | | | | |
| 0,800 % fällig am 26.04.2029 | € | 1.800 | 2.052 | 0,51 |
| **Bayview Financial Asset Trust** | | | | |
| 3,977 % fällig am 25.03.2037 | $ | 764 | 776 | 0,19 |
| **Bosphorus CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 15.04.2027 | € | 3.415 | 3.888 | 0,97 |
| **Business Jet Securities LLC** | | | | |
| 4,447 % fällig am 15.06.2033 | $ | 82 | 83 | 0,02 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,064 % fällig am 25.06.2035 | | 5.000 | 4.990 | 1,24 |
| **College Avenue Student Loans LLC** | | | | |
| 3,604 % fällig am 26.12.2047 | | 47 | 47 | 0,01 |
| 4,130 % fällig am 26.12.2047 | | 47 | 49 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.06.2047 | | 3.307 | 3.126 | 0,78 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 3,529 % fällig am 25.03.2035 | | 69 | 67 | 0,02 |
| **Figueroa CLO Ltd.** | | | | |
| 3,237 % fällig am 20.06.2027 | | 100 | 100 | 0,03 |
| **Harvest SBA Loan Trust** | | | | |
| 4,654 % fällig am 25.08.2044 | | 856 | 859 | 0,21 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.01.2037 | | 4.207 | 3.358 | 0,83 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.06.2046 | | 81 | 81 | 0,02 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.06.2036 | | 920 | 881 | 0,22 |
| **LP Credit Card ABS Master Trust** | | | | |
| 4,053 % fällig am 20.08.2024 | | 221 | 219 | 0,05 |
| **Marlette Funding Trust** | | | | |
| 3,710 % fällig am 15.12.2028 | | 71 | 71 | 0,02 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.05.2037 | | 5.482 | 3.260 | 0,81 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 3,829 % fällig am 25.01.2035 | | 1.330 | 1.226 | 0,30 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.12.2034 | | 100 | 101 | 0,03 |
| **Navient Student Loan Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 27.06.2067 | | 232 | 232 | 0,06 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,829 % fällig am 25.11.2034 | | 1.458 | 1.466 | 0,36 |
| **Orwell Park CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,780 % fällig am 18.07.2029 | € | 2.300 | 2.623 | 0,65 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 3,484 % fällig am 25.03.2035 | $ | 2.000 | 2.003 | 0,50 |
| **RMAT LP** | | | | |
| 4,090 % fällig am 25.05.2048 | | 59 | 59 | 0,01 |
| **SoFi Professional Loan Program Trust** | | | | |
| 3,120 % fällig am 25.02.2048 | | 743 | 750 | 0,19 |
| **St Paul's CLO DAC** | | | | |
| 0,850 % fällig am 20.08.2030 | € | 3.500 | 3.989 | 0,99 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 3,124 % fällig am 25.01.2036 | $ | 1.142 | $ 1.141 | 0,28 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.05.2047 | | 487 | 470 | 0,12 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | | |
| 3,784 % fällig am 25.03.2035 | | 710 | 663 | 0,17 |
| **Tralee CLO Ltd.** | | | | |
| 3,702 % fällig am 20.10.2028 | | 250 | 249 | 0,06 |
| **VCL Multi-Compartment S.A.** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.01.2025 | € | 185 | 212 | 0,05 |
| | | | 40.010 | 9,94 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | | 200 | 178 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 31.12.2038 | $ | 2.896 | 1.701 | 0,42 |
| 4,625 % fällig am 11.01.2023 | | 1.424 | 1.143 | 0,28 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2027 | € | 700 | 585 | 0,15 |
| 5,625 % fällig am 26.01.2022 | $ | 40 | 34 | 0,01 |
| 40,244 % fällig am 04.10.2022 | ARS | 460 | 16 | 0,00 |
| 53,892 % fällig am 01.03.2020 (a) | | 170 | 4 | 0,00 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | | 147.600 | 3.399 | 0,85 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | PEN | 93 | 29 | 0,01 |
| 5,700 % fällig am 12.08.2024 | | 167 | 55 | 0,01 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | | 3.026 | 1.004 | 0,25 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 1.102 | 369 | 0,09 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 1.534 | 524 | 0,13 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 221 | 79 | 0,02 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 1.532 | 580 | 0,14 |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 17.04.2025 | $ | 1.500 | 1.599 | 0,40 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 4,625 % fällig am 31.03.2025 | € | 500 | 569 | 0,14 |
| 7,250 % fällig am 23.12.2023 | $ | 800 | 828 | 0,21 |
| 7,625 % fällig am 26.04.2029 | | 600 | 616 | 0,15 |
| **Venezuela Government International Bond** | | | | |
| 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^ | | 2.000 | 550 | 0,14 |
| 9,000 % fällig am 07.05.2023 ^ | | 1.600 | 440 | 0,11 |
| | | | 14.302 | 3,55 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| **Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (d)** | 173.174 | 818 | 0,20 |
| **iHeartMedia, Inc. (d)** | 63.713 | 959 | 0,24 |
| **iHeartMedia, Inc. 'A' (d)** | 9.783 | 147 | 0,04 |
| **iHeartMedia, Inc. 'B' (d)** | 130 | 2 | 0,00 |
| | | 1.926 | 0,48 |
| **ENERGIE** | | | |
| **Westmoreland Mining Holdings LLC (i)** | 231 | 3 | 0,00 |
| | | 1.929 | 0,48 |

| | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (k)** | | | |
| | | 48.717 | 12,10 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 48.717 | 12,10 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | 3.840 | 38.458 | 9,55 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 504.096** | **125,24** |

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

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 81 | $ (143) | (0,03) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 473 | 1.304 | 0,32 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 26 | 175 | 0,04 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09/2019 | 90 | (112) | (0,03) |
| | | | | $ 1.224 | 0,30 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 1.224** | **0,30** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Deutsche Bank AG | 1,000 % | 20.12.2019 | € 400 | $ 0 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2020 | $ 200 | 8 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 400 | 32 | 0,01 |
| | | | | $ 40 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-32 5-Year Index | (5,000) % | 20.06.2024 | $ 1.400 | $ (14) | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 3.500 | $ 12 | 0,00 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 7.000 | 28 | 0,01 |
| | | | | $ 40 | 0,01 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,543 % | 05.02.2024 | $ 1.000 | $ (41) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,550 | 05.02.2024 | 1.000 | (42) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,559 | 05.02.2024 | 1.000 | (42) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,571 | 05.02.2024 | 500 | (21) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,580 | 05.02.2024 | 1.500 | (65) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,605 | 05.02.2024 | 1.500 | (67) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,607 | 05.02.2024 | 500 | (22) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2023 | 19.100 | (1.010) | (0,25) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 24.000 | (676) | (0,17) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2026 | 12.700 | (499) | (0,12) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2028 | 20.400 | (1.899) | (0,47) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 9.300 | (166) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 16.900 | (2.726) | (0,68) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2049 | 2.600 | 270 | 0,07 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,000 | 21.03.2027 | AUD 12.400 | 805 | 0,20 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | € 2.500 | (164) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | £ 800 | (82) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 20.03.2029 | ¥ 3.660.000 | (1.365) | (0,34) |
| | | | | | $ (7.812) | (1,94) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (7.746)** | **(1,92)** |

(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 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.

**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 | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 600 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 3.300 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 200 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 97,000 | 20.11.2019 | 1.100 | (4) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 99,000 | 16.10.2019 | 1.100 | (4) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 1.300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 900 | (1) | 0 | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 | 21.08.2019 | 4.300 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 1.300 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 93,000 | 16.10.2019 | 2.300 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 94,000 | 16.10.2019 | 1.700 | (3) | (1) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (31) | $ (9) | 0,00 |

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2023 | $ 100 | $ (6) | $ 5 | $ (1) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 1.800 | (100) | 74 | (26) | (0,01) |
| BPS | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 100 | (2) | 1 | (1) | 0,00 |
| CBK | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2023 | 16 | 1 | (3) | (2) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 100 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 1.700 | (86) | 62 | (24) | (0,01) |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.09.2019 | 6.900 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 300 | (10) | 6 | (4) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 600 | (18) | 4 | (14) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 400 | (6) | 4 | (2) | 0,00 |
| MYC | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 500 | (81) | 17 | (64) | (0,01) |
| NGF | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 5.500 | (156) | 170 | 14 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (9) | 4 | (5) | 0,00 |
| | | | | | $ (466) | $ 348 | $ (118) | (0,03) |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MEI | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 % | 17.08.2061 | $ 300 | $ (2) | $ 2 | $ 0 | 0,00 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 25.375 | (78) | 281 | 203 | 0,06 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 25.375 | (194) | 295 | 101 | 0,02 |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 300 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ (276) | $ 580 | $ 304 | 0,08 |

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

(2) 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 | Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,850 % | 13.07.2022 | $ 50.000 | $ 0 | $ 1.453 | $ 1.453 | 0,36 |

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

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 08/2019 | € | 43.474 | $ | 49.222 | $ 0 | $ (461) | $ (461) | (0,11) |
| | 08/2019 | $ | 435 | AUD | 628 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 691 | € | 613 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 3.453 | RUB | 226.850 | 121 | 0 | 121 | 0,03 |
| BPS | 07/2019 | TRY | 5.441 | $ | 940 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 71 | ARS | 3.581 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 940 | TRY | 5.471 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ARS | 26.823 | $ | 601 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 19.877 | | 25.867 | 517 | 0 | 517 | 0,13 |
| | 08/2019 | ¥ | 483.000 | | 4.442 | 1 | (57) | (56) | (0,01) |
| | 10/2019 | PEN | 218 | | 65 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BRC | 08/2019 | $ | 7.894 | € | 7.018 | 127 | 0 | 127 | 0,03 |
| CBK | 08/2019 | | 2.387 | £ | 1.881 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 09/2019 | PEN | 53 | $ | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | € | 66 | | 75 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 248 | ARS | 12.471 | 34 | 0 | 34 | 0,01 |
| | 08/2019 | PEN | 40 | $ | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 3.590 | MXN | 70.319 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| MSB | 09/2019 | | 761 | RUB | 50.342 | 29 | 0 | 29 | 0,01 |
| MYI | 08/2019 | AUD | 4.826 | $ | 3.374 | 0 | (18) | (18) | (0,01) |
| | 08/2019 | NZD | 2.643 | | 1.743 | 0 | (35) | (35) | (0,01) |
| SCX | 07/2019 | $ | 594 | RUB | 39.369 | 29 | 0 | 29 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.209 | TRY | 7.176 | 32 | 0 | 32 | 0,01 |
| | | | | | | $ 941 | $ (572) | $ 369 | 0,09 |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Institutional CHF (Hedged) ausschüttend, Class E CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 583 | CHF | 585 | $ 17 | $ 0 | $ 17 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | | 583 | | 587 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | CHF | 602 | $ | 614 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 583 | CHF | 585 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 616 | | 602 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 602 | $ | 616 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 618 | CHF | 602 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 30 | | 30 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | | | $ 56 | $ (4) | $ 52 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Investor EUR (Hedged) ausschüttend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 102.352 | $ | 116.312 | $ 0 | $ (246) | $ (246) | (0,06) |
| | 08/2019 | $ | 116.609 | € | 102.352 | 247 | 0 | 247 | 0,06 |
| BPS | 07/2019 | € | 99.390 | $ | 113.006 | 0 | (179) | (179) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 280 | € | 249 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 113.294 | | 99.390 | 180 | 0 | 180 | 0,05 |
| BRC | 07/2019 | | 113.362 | | 101.362 | 2.069 | 0 | 2.069 | 0,51 |
| CBK | 07/2019 | € | 102.352 | $ | 116.323 | 0 | (235) | (235) | (0,06) |
| | 07/2019 | $ | 75 | € | 66 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 116.619 | | 102.352 | 237 | 0 | 237 | 0,06 |
| MYI | 07/2019 | | 113.343 | | 101.362 | 2.088 | 0 | 2.088 | 0,52 |
| SCX | 07/2019 | € | 151 | $ | 169 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | $ | 113.096 | € | 101.271 | 2.231 | 0 | 2.231 | 0,55 |
| | | | | | | $ 7.055 | $ (662) | $ 6.393 | 1,59 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend und Institutional GBP (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | £ | 400 | $ | 508 | $ 0 | $ (2) | $ (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 417 | £ | 331 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 509 | | 400 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | £ | 399 | $ | 507 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 498 | £ | 395 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 508 | | 399 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 81 | | 64 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 497 | | 395 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | | | | | | $ 18 | $ (3) | $ 15 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | SGD | 86 | $ | 64 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 63 | SGD | 87 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 64 | | 87 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | SGD | 86 | $ | 64 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 64 | SGD | 87 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 63 | | 86 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SGD | 86 | $ | 63 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 125 | SGD | 172 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 63 | | 86 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SGD | 86 | $ | 64 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 62 | SGD | 84 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 5 | $ 0 | $ 5 | 0,00 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 8.464** | **2,10** |

| | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 2,980 % fällig am 25.10.2019 | $ 1.800 | 1.802 | 0,45 |
| **Summe Anlagen** | | **$ 507.840** | **126,17** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (105.346)** | **(26,17)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 402.494** | **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)** **Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b)** **Wertpapier per Emissionstermin.**

**(c)** **Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(d)** **Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(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)** **Beschränkte Wertpapiere:**

| Emittent Beschreibung | Erwerbsdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| Westmoreland Mining Holdings LLC | 08.12.2014 - 26.03.2019 | $ 1 | $ 3 | 0,00 |

**(j)** **Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 501 als Sicherheiten verpfändet.**

**Barmittel in Höhe von USD 4.039 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 280 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(k)** **Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 917 | U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2021 | $ (938) | $ 917 | $ 917 | 0,23 |
| MBC | 2,680 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 26.600 | U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.08.2028 | (27.493) | 26.600 | 26.606 | 6,60 |
| TDM | 2,600 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 21.200 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2046 | (21.733) | 21.200 | 21.205 | 5,27 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (50.164)** | **$ 48.717** | **$ 48.728** | **12,10** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

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

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 39.423 | $ 463.697 | $ 976 | $ 504.096 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.802 | 0 | 1.802 |
| Finanzderivate[3] | 1.224 | 718 | 0 | 1.942 |
| **Summen** | **$ 40.647** | **$ 466.217** | **$ 976** | **$ 507.840** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 36.526 | $ 387.160 | $ 2.904 | $ 426.590 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.801 | 0 | 1.801 |
| Finanzderivate[3] | 1.516 | (1.702) | 0 | (186) |
| **Summen** | **$ 38.042** | **$ 387.259** | **$ 2.904** | **$ 428.205** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BCY | 1,850 % | 13.05.2019 | TBD[1] | $ (501) | $ (502) | (0,12) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (502)** | **(0,12)** |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (332) | $ 280 | $ (52) |
| BPS | 479 | (460) | 19 |
| BRC | 2.210 | (2.010) | 200 |
| CBK | 6 | 0 | 6 |
| HUS | 39 | 0 | 39 |
| MSB | 29 | 0 | 29 |
| MYC | 1.694 | (1.840) | (146) |
| MYI | 2.036 | (1.900) | 136 |
| NGF | 8 | 0 | 8 |
| SCX | 59 | 0 | 59 |
| SSB | 2.236 | (2.130) | 106 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 47,26 | 50,71 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 65,88 | 56,63 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 12,10 | 5,58 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,30 | 0,40 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,92) | (0,44) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 2,10 | (0,01) |
| Einlagenzertifikate | 0,45 | 0,48 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,12) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 2,20 | 3,54 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 42,94 | 42,32 |
| US-Regierungsbehörden | 28,46 | 15,18 |
| US-Schatzobligationen | 3,89 | 0,79 |
| Non-Agency-MBS | 12,13 | 9,25 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 9,94 | 11,42 |
| Staatsemissionen | 3,55 | 1,61 |
| Stammaktien | 0,48 | 0,00 |
| Vorzugswertpapiere | 0,00 | 0,30 |
| Kurzfristige Instrumente | 12,10 | 18,84 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 9,55 | 9,67 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,30 | 0,40 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Verkauf Schutz | 0,01 | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | 0,04 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Zinsswaps | (1,94) | (0,48) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Verkauf Schutz | (0,03) | (0,09) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,08 | (0,20) |
| Zinsswaps | 0,36 | 0,22 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,00 | (0,04) |
| Devisenterminkontrakte | 0,09 | (0,13) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,60 | 0,25 |
| Einlagenzertifikate | 0,45 | 0,48 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (26,17) | (13,35) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KANADA** | | | |
| **ENERGIE** | | | |
| Enbridge, Inc. | 70.000 | $ 2.534 | 0,99 |
| TC Energy Corp. | 86.015 | 4.273 | 1,66 |
| | | 6.807 | 2,65 |
| **USA** | | | |
| **ENERGIE** | | | |
| Antero Midstream Corp. | 492.416 | 5.643 | 2,20 |
| Cheniere Energy, Inc. (a) | 119.500 | 8.180 | 3,18 |
| EnLink Midstream LLC | 531.450 | 5.362 | 2,09 |
| Kinder Morgan, Inc. | 334.000 | 6.974 | 2,71 |
| Marathon Petroleum Corp. | 48.000 | 2.682 | 1,04 |
| ONEOK, Inc. | 152.500 | 10.494 | 4,08 |
| Tallgrass Energy LP | 136.410 | 2.880 | 1,12 |
| Targa Resources Corp. | 164.500 | 6.458 | 2,51 |
| Valero Energy Corp. | 31.000 | 2.654 | 1,03 |
| Williams Cos., Inc. | 228.500 | 6.407 | 2,49 |
| | | 57.734 | 22,45 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| **Boston Scientific Corp.** | | | |
| 2,910 % fällig am 09.07.2019 | $ 300 | $ 300 | 0,11 |
| **Broadcom, Inc.** | | | |
| 2,830 % fällig am 18.07.2019 | 250 | 249 | 0,10 |
| 2,870 % fällig am 16.07.2019 | 250 | 250 | 0,10 |
| 2,910 % fällig am 09.07.2019 | 250 | 250 | 0,10 |
| **Campbell Soup Co.** | | | |
| 3,100 % fällig am 14.08.2019 | 3.700 | 3.687 | 1,43 |
| **Royal Caribbean Cruise** | | | |
| 2,900 % fällig am 11.07.2019 | 300 | 300 | 0,11 |
| 2,900 % fällig am 15.07.2019 | 250 | 250 | 0,10 |
| 2,970 % fällig am 01.07.2019 | 250 | 250 | 0,10 |
| **VW Credit, Inc.** | | | |
| 2,900 % fällig am 10.07.2019 | 2.500 | 2.498 | 0,97 |
| | | 8.034 | 3,12 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (e)** | | | |
| | | 563 | 0,22 |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 2,240 % fällig am 14.08.2019 (b)(c) | 2.400 | 2.393 | 0,93 |
| 2,243 % fällig am 16.08.2019 (b)(c) | $ 6.900 | $ 6.881 | 2,68 |
| 2,254 % fällig am 21.08.2019 (b)(c) | 2.700 | 2.692 | 1,05 |
| 2,285 % fällig am 10.07.2019 (b)(c) | 2.800 | 2.798 | 1,09 |
| 2,294 % fällig am 07.08.2019 (b)(c) | 3.400 | 3.392 | 1,32 |
| 2,314 % fällig am 11.09.2019 (b)(c) | 4.500 | 4.481 | 1,74 |
| 2,336 % fällig am 03.07.2019 (b)(c) | 14.800 | 14.798 | 5,75 |
| 2,359 % fällig am 31.07.2019 (b)(c) | 10.900 | 10.880 | 4,23 |
| 2,434 % fällig am 05.07.2019 (b)(c) | 49.400 | 49.388 | 19,20 |
| 2,438 % fällig am 10.07.2019 (b)(c) | 11.900 | 11.893 | 4,62 |
| 2,443 % fällig am 09.07.2019 (b)(c) | 2.400 | 2.399 | 0,93 |
| 2,461 % fällig am 03.07.2019 (b)(c) | 44.800 | 44.795 | 17,42 |
| | | 156.790 | 60,96 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 165.387 | 64,30 |

| | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | 2.504.950 | $ 25.087 | 9,75 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 255.015** | **99,15** |

**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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Erhalt | AMZX Index | 17.986 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 22.447 | 19.09.2019 | $ 0 | $ (71) | $ (71) | (0,02) |
| CBK | Erhalt | AMZX Index | 1.129 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.385 | 20.09.2019 | 0 | 25 | 25 | 0,0 |
| | Erhalt | AMZX Index | 850 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.072 | 20.11.2019 | 0 | (13) | (13) | (0,01) |
| FAR | Erhalt | AMZX Index | 4.600 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 5.701 | 15.06.2020 | 0 | 49 | 49 | 0,0 |
| | | | | | | | $ 0 | $ (10) | $ (10) | (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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | Antero Midstream Partners LP | 2.256 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 27 | 15.11.2019 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | Erhalt | Enterprise Products Partners LP | 761.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 21.825 | 15.11.2019 | 0 | 123 | 123 | 0,05 |
| | Erhalt | Plains All American Pipeline LP | 806.500 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 19.041 | 15.11.2019 | 0 | 578 | 578 | 0,22 |
| | Erhalt | Energy Transfer LP | 518.869 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 7.300 | 20.12.2019 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | Erhalt | MPLX LP | 208.909 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 6.537 | 20.12.2019 | 0 | 182 | 182 | 0,07 |
| | Erhalt | Phillips 66 Partners LP | 164.800 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 8.189 | 20.12.2019 | 0 | (64) | (64) | (0,02) |
| | Erhalt | Tallgrass Energy LP | 18.500 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 405 | 20.12.2019 | 0 | (14) | (14) | (0,01) |
| | Erhalt | Western Midstream Partners LP | 74.281 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.158 | 15.01.2020 | 0 | 126 | 126 | 0,05 |
| | Erhalt | Crestwood Equity Partners LP | 86.200 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.005 | 12.02.2020 | 0 | 75 | 75 | 0,03 |
| | Erhalt | DCP Midstream LP | 272.500 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 7.848 | 12.02.2020 | 0 | 129 | 129 | 0,05 |
| | Erhalt | Energy Transfer LP | 1.068.210 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 15.030 | 16.03.2020 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | Erhalt | Crestwood Equity Partners LP | 39.800 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.387 | 15.05.2020 | 0 | 35 | 35 | 0,01 |
| | Erhalt | Enable Midstream Partners LP | 132.214 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.729 | 15.05.2020 | 0 | 82 | 82 | 0,03 |
| | Erhalt | EQT Midstream Partners LP | 34.238 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.490 | 15.05.2020 | 0 | 38 | 38 | 0,01 |
| | Erhalt | MPLX LP | 406.591 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 12.722 | 15.05.2020 | 0 | 353 | 353 | 0,14 |
| CBK | Erhalt | Tallgrass Energy LP | 83.590 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 1.828 | 15.10.2019 | 0 | (65) | (65) | (0,03) |
| | Erhalt | CNX Midstream Partners LP | 69.500 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.019 | 15.01.2020 | 0 | (45) | (45) | (0,02) |

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Erhalt | Cheniere Energy Partners LP | 52.000 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | $ 2.176 | 15.05.2020 | $ 0 | $ 17 | $ 17 | 0,01 |
| FAR | Erhalt | Phillips 66 Partners LP | 18.200 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 904 | 31.01.2020 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | Erhalt | Plains All American Pipeline LP | 43.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.015 | 31.01.2020 | 0 | 31 | 31 | 0,01 |
| GST | Erhalt | Enable Midstream Partners LP | 159.312 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 2.111 | 15.06.2020 | 0 | 72 | 72 | 0,03 |
| MYI | Erhalt | Noble Midstream Partners LP | 77.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.329 | 15.07.2019 | 0 | 227 | 227 | 0,09 |
| | Erhalt | Enterprise Products Partners LP | 101.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.897 | 16.09.2019 | 0 | 16 | 16 | 0,01 |
| | Erhalt | EQT Midstream Partners LP | 110.222 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 4.797 | 16.09.2019 | 0 | 123 | 123 | 0,05 |
| | Erhalt | Enable Midstream Partners LP | 76.974 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.007 | 15.11.2019 | 0 | 48 | 48 | 0,02 |
| | Erhalt | Magellan Midstream Partners LP | 92.780 | 1-Month USD-LIBOR abzgl. eines bestimmten Spreads | 5.814 | 15.11.2019 | 0 | 120 | 120 | 0,05 |
| | Erhalt | NuStar Energy LP | 23.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 602 | 15.11.2019 | 0 | 21 | 21 | 0,01 |
| | Erhalt | Western Midstream Partners LP | 185.942 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 5.402 | 15.11.2019 | 0 | 315 | 315 | 0,12 |
| | Erhalt | Cheniere Energy Partners LP | 15.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 628 | 13.12.2019 | 0 | 4 | 4 | 0,00 |
| | Erhalt | Crestwood Equity Partners LP | 50.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.743 | 13.12.2019 | 0 | 44 | 44 | 0,02 |
| | Erhalt | Noble Midstream Partners LP | 1.500 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 47 | 13.12.2019 | 0 | 3 | 3 | 0,00 |
| | Erhalt | Enable Midstream Partners LP | 213.000 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 2.786 | 16.03.2020 | 0 | 132 | 132 | 0,05 |
| | Erhalt | NuStar Energy LP | 194.089 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 5.083 | 16.03.2020 | 0 | 180 | 180 | 0,07 |
| | Erhalt | Western Midstream Partners LP | 40.689 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 1.182 | 15.04.2020 | 0 | 69 | 69 | 0,03 |
| | Erhalt | Magellan Midstream Partners LP | 58.720 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 3.679 | 15.05.2020 | 0 | 75 | 75 | 0,03 |
| | | | | | | | $ 0 | $ 3.016 | $ 3.016 | 1,18 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 6.592 | CAD | 8.670 | $ 44 | $ 0 | $ 44 | 0,02 |
| | 08/2019 | CAD | 8.670 | $ | 6.596 | 0 | (43) | (43) | (0,02) |
| BPS | 08/2019 | $ | 140 | € | 124 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 8.670 | $ | 6.432 | 0 | (203) | (203) | (0,08) |
| | 07/2019 | $ | 286 | € | 252 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 45 | $ (246) | $ (201) | (0,08) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend und Investor EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 12.094 | $ | 13.744 | $ 0 | $ (29) | $ (29) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 13.779 | € | 12.094 | 29 | 0 | 29 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | € | 11.510 | $ | 13.086 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 175 | € | 154 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 13.045 | | 11.444 | 21 | 0 | 21 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | | 14.601 | | 13.056 | 267 | 0 | 267 | 0,10 |
| CBK | 07/2019 | € | 15.072 | $ | 17.140 | 4 | (28) | (24) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 45 | € | 39 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 13.780 | | 12.094 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | | 572 | | 512 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 14.599 | | 13.056 | 269 | 0 | 269 | 0,12 |
| SCX | 07/2019 | € | 1.161 | $ | 1.302 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| SSB | 07/2019 | $ | 3 | € | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 14.599 | | 13.056 | 269 | 0 | 269 | 0,11 |
| | | | | | | $ 899 | $ (99) | $ 800 | 0,32 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | £ 352 | $ 443 | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 736 | £ 581 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 9.863 | $ 12.510 | 0 | (43) | (43) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ 12.529 | £ 9.863 | 43 | 0 | 43 | 0,02 |
| CBK | 07/2019 | £ 9.903 | $ 12.583 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 12.861 | £ 10.149 | 56 | (1) | 55 | 0,03 |
| | 08/2019 | 12.602 | 9.903 | 21 | 0 | 21 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | £ 783 | $ 990 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | $ 12.563 | £ 9.926 | 70 | 0 | 70 | 0,03 |
| SSB | 07/2019 | 12.483 | 9.880 | 90 | 0 | 90 | 0,03 |
| | | | | $ 283 | $ (75) | $ 208 | 0,09 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 3.813** | **1,48** |
| **Summe Anlagen** | | | | | | **$ 258.828** | **100,63** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | | | | | **$ (1.628)** | **(0,63)** |
| **Nettovermögen** | | | | | | **$ 257.200** | **100,00** |

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

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

(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(b) Nullkuponwertpapier.

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

(d) Mit dem Fonds verbunden.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 720 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(e) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 563 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (574) | $ 563 | $ 563 | 0,22 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (574)** | **$ 563** | **$ 563** | **0,22** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbre Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 89.628 | $ 165.387 | $ 0 | $ 255.015 |
| Finanzderivate[3] | 0 | 3.813 | 0 | 3.813 |
| **Summen** | **$ 89.628** | **$ 169.200** | **$ 0** | **$ 258.828** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 56.434 | $ 189.068 | $ 0 | $ 245.502 |
| Finanzderivate[3] | 0 | (10.112) | 0 | (10.112) |
| **Summen** | **$ 56.434** | **$ 178.956** | **$ 0** | **$ 235.390** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 1.636 | $ (400) | $ 1.236 |
| BPS | (71) | 580 | 509 |
| BRC | 267 | (260) | 7 |
| CBK | (21) | 140 | 119 |
| FAR | 73 | 0 | 73 |
| GLM | 5 | 0 | 5 |
| GST | 72 | 0 | 72 |
| HUS | (203) | 0 | (203) |
| MYI | 1.646 | (1.060) | 586 |
| SCX | 50 | 0 | 50 |
| SSB | 90 | 0 | 90 |
| TOR | 269 | (280) | (11) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 25,10 | 13,62 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 73,83 | 85,72 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,22 | 0,38 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,48 | (4,11) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kanada | 2,65 | 0,00 |
| Vereinigte Staaten | 22,45 | 13,62 |
| Kurzfristige Instrumente | 64,30 | 76,79 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 9,75 | 9,31 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Total Return Swaps auf Indizes | (0,03) | (0,45) |
| Total Return Swaps auf Wertpapiere | 1,18 | (3,78) |
| Devisenterminkontrakte | (0,08) | 0,01 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,41 | 0,11 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (0,63) | 4,39 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | | |
| 2,000 % fällig am 29.01.2024 | € | 4.600 | $ 5.412 | 0,33 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (e)(g) | £ | 2.600 | 3.463 | 0,21 |
| **U.S. Capital Funding Ltd.** | | | | |
| 2,864 % fällig am 10.07.2043 | $ | 23.998 | 21.478 | 1,32 |
| | | | 30.353 | 1,86 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **Times Square Hotel Trust** | | | | |
| 8,528 % fällig am 01.08.2026 | | 179 | 210 | 0,01 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 30.563 | 1,87 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, Series 2006** | | | | |
| 2,710 % fällig am 25.10.2036 | | 2.117 | 2.104 | 0,13 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 0,000 % fällig am 25.05.2033 - 25.05.2048 (b)(c) | | 20.155 | 17.701 | 1,08 |
| 0,200 % fällig am 25.02.2043 (a) | | 5.121 | 44 | 0,00 |
| 1,546 % fällig am 25.08.2047 (a) | | 78.396 | 5.958 | 0,37 |
| 1,592 % fällig am 25.10.2042 | | 67 | 64 | 0,00 |
| 1,770 % fällig am 25.03.2045 (a) | | 3.096 | 155 | 0,01 |
| 2,340 % fällig am 25.06.2043 | | 812 | 749 | 0,05 |
| 2,393 % fällig am 25.11.2042 - 25.06.2043 | | 286 | 262 | 0,02 |
| 2,472 % fällig am 25.12.2042 | | 88 | 78 | 0,00 |
| 2,500 % fällig am 25.12.2027 (a) | | 4.713 | 313 | 0,02 |
| 2,532 % fällig am 25.03.2033 | | 315 | 324 | 0,02 |
| 2,560 % fällig am 25.03.2047 | | 53 | 53 | 0,00 |
| 2,815 % fällig am 25.03.2033 | | 762 | 784 | 0,05 |
| 3,000 % fällig am 25.11.2027 - 25.05.2048 (a) | | 83.386 | 8.375 | 0,51 |
| 3,000 % fällig am 25.01.2028 (a) | | 2.016 | 149 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 25.12.2020 - 25.04.2046 | | 29.909 | 3.959 | 0,24 |
| 3,500 % fällig am 25.07.2021 - 25.11.2047 (a) | | 30.696 | 4.557 | 0,28 |
| 3,596 % fällig am 25.07.2046 (a) | | 30.696 | 6.805 | 0,42 |
| 3,605 % fällig am 25.10.2043 | | 910 | 962 | 0,06 |
| 3,640 % fällig am 25.11.2042 | | 1.089 | 1.133 | 0,07 |
| 3,646 % fällig am 25.10.2042 (a) | | 10.355 | 1.874 | 0,11 |
| 3,660 % fällig am 25.09.2048 | | 3.713 | 394 | 0,02 |
| 3,696 % fällig am 25.06.2037 (a) | | 825 | 88 | 0,01 |
| 3,723 % fällig am 25.05.2043 | | 258 | 271 | 0,02 |
| 3,746 % fällig am 25.02.2046 - 25.09.2047 (a) | | 17.548 | 3.041 | 0,19 |
| 3,796 % fällig am 25.11.2047 - 25.05.2048 (a) | | 48.161 | 8.129 | 0,50 |
| 3,846 % fällig am 25.04.2043 (a) | | 5.769 | 650 | 0,04 |
| 3,870 % fällig am 01.07.2027 (i) | | 1.600 | 1.749 | 0,11 |
| 3,896 % fällig am 25.05.2030 (a) | | 4.993 | 665 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 25.09.2020 - 25.06.2048 (a) | | 43.260 | 6.793 | 0,42 |
| 4,000 % fällig am 25.04.2032 (a) | | 1.323 | 153 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 25.04.2045 - 25.05.2047 | | 7.844 | 3.041 | 0,19 |
| 4,050 % fällig am 01.12.2028 (i) | | 1.950 | 2.166 | 0,13 |
| 4,126 % fällig am 25.01.2041 (a) | | 494 | 103 | 0,01 |
| 4,196 % fällig am 25.09.2040 (a) | | 3.266 | 423 | 0,03 |
| 4,213 % fällig am 25.08.2033 | | 474 | 509 | 0,03 |
| 4,246 % fällig am 25.03.2039 (a) | | 4.174 | 285 | 0,02 |
| 4,280 % fällig am 25.08.2033 | | 176 | 186 | 0,01 |
| 4,296 % fällig am 25.07.2026 (a) | | 11.352 | 853 | 0,05 |
| 4,396 % fällig am 25.12.2032 (a) | | 1.188 | 203 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 25.06.2029 - 25.09.2046 (a) | | 15.003 | 2.160 | 0,13 |
| 4,500 % fällig am 25.02.2047 | | 779 | 818 | 0,05 |
| 4,696 % fällig am 25.11.2033 - 25.10.2034 (a) | | 1.881 | 277 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 25.04.2034 - 25.12.2035 (a) | | 1.832 | 307 | 0,02 |
| 5,000 % fällig am 25.09.2035 (a) | $ | 595 | $ 101 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 25.05.2043 | | 2.579 | 2.808 | 0,17 |
| 5,030 % fällig am 01.05.2024 | | 876 | 979 | 0,06 |
| 5,196 % fällig am 25.11.2033 (a) | | 111 | 20 | 0,00 |
| 5,227 % fällig am 25.08.2043 | | 187 | 218 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 - 25.05.2036 (a) | | 3.143 | 657 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2043 | | 1.852 | 1.972 | 0,12 |
| 5,620 % fällig am 01.06.2041 | | 511 | 624 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2032 - 25.03.2033 (a) | | 714 | 143 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2041 | | 399 | 484 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2034 (a) | | 3.159 | 666 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 25.04.2042 | | 763 | 934 | 0,06 |
| 7,750 % fällig am 25.11.2042 | | 680 | 848 | 0,05 |
| 7,900 % fällig am 25.07.2023 | | 502 | 545 | 0,03 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.01.2033 | | 686 | 687 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 01.01.2033 (i) | | 2.329 | 2.331 | 0,14 |
| 3,000 % fällig am 01.01.2038 (i) | | 20.461 | 20.844 | 1,28 |
| 3,000 % fällig am 01.04.2038 (i) | | 271 | 276 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 01.03.2038 - 01.12.2047 (i) | | 32.322 | 33.413 | 2,05 |
| 4,000 % fällig am 01.02.2037 - 01.12.2047 (i) | | 40.878 | 42.960 | 2,63 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2038 - 01.10.2047 | | 2.091 | 2.206 | 0,14 |
| 4,500 % fällig am 01.12.2038 - 01.01.2049 (i) | | 28.809 | 30.502 | 1,87 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2044 - 01.01.2049 (i) | | 815 | 862 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 01.06.2048 (i) | | 3.300 | 3.553 | 0,22 |
| 5,000 % fällig am 01.12.2048 - 01.03.2049 | | 1.960 | 2.079 | 0,13 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.08.2034 - 01.08.2049 | | 19.220 | 19.127 | 1,17 |
| 3,000 % fällig am 01.08.2034 - 01.09.2049 | | 108.400 | 109.951 | 6,74 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2034 - 01.09.2049 | | 170.300 | 174.175 | 10,67 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2034 - 01.09.2049 | | 74.201 | 76.808 | 4,71 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2049 | | 4.100 | 4.285 | 0,26 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2049 | | 71.300 | 75.357 | 4,62 |
| **Freddie Mac** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.01.2033 - 15.10.2058 (b)(c) | | 88.483 | 73.454 | 4,50 |
| 0,000 % fällig am 15.08.2057 (c) | | 27.799 | 23.137 | 1,42 |
| 0,532 % fällig am 25.08.2024 (a) | | 63.836 | 1.192 | 0,07 |
| 1,104 % fällig am 15.10.2032 | | 200 | 186 | 0,01 |
| 1,177 % fällig am 15.09.2042 | | 490 | 420 | 0,03 |
| 1,854 % fällig am 15.01.2038 (a) | | 564 | 37 | 0,00 |
| 1,873 % fällig am 15.12.2043 | | 433 | 422 | 0,03 |
| 1,886 % fällig am 15.01.2041 | | 1.678 | 1.650 | 0,10 |
| 2,106 % fällig am 15.08.2040 (a) | | 4.163 | 367 | 0,02 |
| 2,409 % fällig am 15.05.2043 | | 131 | 123 | 0,01 |
| 2,500 % fällig am 15.11.2027 - 15.05.2028 (a) | | 15.048 | 1.005 | 0,06 |
| 2,532 % fällig am 15.11.2032 | | 94 | 95 | 0,01 |
| 2,606 % fällig am 15.04.2042 (a) | | 4.054 | 510 | 0,03 |
| 2,873 % fällig am 15.12.2043 | | 1.880 | 1.920 | 0,12 |
| 3,000 % fällig am 15.03.2027 - 15.09.2048 (a) | | 33.478 | 3.771 | 0,23 |
| 3,000 % fällig am 15.09.2027 - 15.08.2029 | | 5.422 | 468 | 0,03 |
| 3,314 % fällig am 15.12.2027 (a) | | 2.436 | 187 | 0,01 |
| 3,353 % fällig am 15.07.2043 | | 817 | 847 | 0,05 |
| 3,456 % fällig am 15.02.2041 (a) | | 559 | 81 | 0,01 |
| 3,466 % fällig am 15.07.2041 | | 3.174 | 449 | 0,03 |
| 3,496 % fällig am 15.09.2043 (a) | | 2.057 | 374 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 15.01.2032 - 15.06.2043 (a) | | 21.430 | 2.069 | 0,13 |
| 3,500 % fällig am 01.01.2038 - 01.12.2046 | | 14.449 | 14.956 | 0,92 |
| 3,516 % fällig am 15.10.2041 - 15.08.2042 | | 6.335 | 1.009 | 0,06 |
| 3,554 % fällig am 25.09.2024 | | 6.100 | 5.790 | 0,35 |
| 3,606 % fällig am 15.06.2042 (a) | | 21.896 | 3.673 | 0,23 |
| 3,656 % fällig am 15.08.2041 - 15.09.2044 (a) | | 21.055 | 3.309 | 0,20 |
| 3,666 % fällig am 15.06.2048 | | 15.046 | 2.319 | 0,14 |
| 3,706 % fällig am 15.02.2044 (a) | | 813 | 104 | 0,01 |
| 3,716 % fällig am 15.03.2048 | $ | 6.075 | $ 1.115 | 0,07 |
| 3,756 % fällig am 15.08.2025 - 15.10.2048 (a) | | 79.755 | 11.016 | 0,68 |
| 3,806 % fällig am 15.06.2048 (a) | | 13.049 | 1.749 | 0,11 |
| 3,812 % fällig am 15.06.2037 - 15.06.2044 | | 4.538 | 4.889 | 0,30 |
| 3,856 % fällig am 15.09.2042 (a) | | 2.241 | 341 | 0,02 |
| 3,906 % fällig am 15.10.2036 (a) | | 2.338 | 398 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 15.10.2041 - 15.09.2048 (a) | | 855 | 127 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2043 - 15.04.2044 | | 6.800 | 6.936 | 0,43 |
| 4,000 % fällig am 01.04.2044 - 01.03.2048 (i) | | 29.873 | 31.345 | 1,92 |
| 4,076 % fällig am 15.11.2037 (a) | | 453 | 76 | 0,00 |
| 4,106 % fällig am 15.01.2039 (a) | | 996 | 38 | 0,00 |
| 4,206 % fällig am 15.07.2023 - 15.11.2041 (a) | | 513 | 64 | 0,00 |
| 4,306 % fällig am 15.09.2026 - 15.12.2042 (a) | | 8.495 | 1.550 | 0,10 |
| 4,312 % fällig am 15.05.2041 | | 804 | 870 | 0,05 |
| 4,336 % fällig am 15.09.2039 (a) | | 5.742 | 1.116 | 0,07 |
| 4,408 % fällig am 15.01.2041 | | 298 | 362 | 0,02 |
| 4,456 % fällig am 15.03.2038 (a) | | 765 | 102 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2041 (a) | | 674 | 74 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.08.2043 - 15.12.2046 | | 1.120 | 1.189 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 01.02.2048 (i) | | 2.616 | 2.808 | 0,17 |
| 5,000 % fällig am 15.05.2025 - 01.03.2049 | | 17.732 | 18.090 | 1,11 |
| 5,000 % fällig am 15.08.2035 (a) | | 577 | 96 | 0,01 |
| 5,227 % fällig am 15.08.2043 | | 459 | 536 | 0,03 |
| 5,506 % fällig am 15.12.2031 (a) | | 126 | 23 | 0,00 |
| 5,634 % fällig am 15.05.2041 | | 1.425 | 1.652 | 0,10 |
| 6,180 % fällig am 15.03.2041 | | 360 | 474 | 0,03 |
| 7,570 % fällig am 15.09.2032 | | 613 | 715 | 0,04 |
| **Ginnie Mae** | | | | |
| 0,000 % fällig am 20.08.2033 - 20.01.2044 (b)(c) | | 8.865 | 8.127 | 0,50 |
| 0,000 % fällig am 20.09.2042 | | 975 | 930 | 0,06 |
| 0,048 % fällig am 20.08.2047 | | 15.820 | 512 | 0,03 |
| 0,379 % fällig am 20.06.2046 (a) | | 23.320 | 626 | 0,04 |
| 0,481 % fällig am 20.01.2047 | | 16.654 | 483 | 0,03 |
| 0,487 % fällig am 20.05.2047 (a) | | 28.002 | 922 | 0,06 |
| 0,505 % fällig am 20.11.2046 (a) | | 18.486 | 610 | 0,04 |
| 0,511 % fällig am 20.10.2046 | | 17.460 | 468 | 0,03 |
| 0,766 % fällig am 20.06.2042 | | 6.079 | 222 | 0,01 |
| 0,830 % fällig am 20.07.2046 (a) | | 17.645 | 533 | 0,03 |
| 0,839 % fällig am 20.06.2042 (a) | | 5.559 | 221 | 0,01 |
| 0,866 % fällig am 20.11.2046 (a) | | 23.813 | 646 | 0,04 |
| 0,945 % fällig am 20.07.2041 (a) | | 3.601 | 114 | 0,01 |
| 1,031 % fällig am 20.05.2040 (a) | | 11.751 | 449 | 0,03 |
| 1,124 % fällig am 20.06.2043 (a) | | 4.584 | 153 | 0,01 |
| 1,149 % fällig am 20.04.2043 (a) | | 23.636 | 719 | 0,04 |
| 2,500 % fällig am 20.09.2027 (a) | | 14.061 | 940 | 0,06 |
| 3,167 % fällig am 20.09.2043 (a) | | 2.929 | 337 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 20.01.2047 (i) | | 1.242 | 1.276 | 0,08 |
| 3,317 % fällig am 20.03.2058 | | 371 | 376 | 0,02 |
| 3,377 % fällig am 20.01.2066 | | 149 | 151 | 0,01 |
| 3,500 % fällig am 16.04.2041 - 20.09.2046 (a) | | 2.341 | 386 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2042 - 20.04.2046 | | 1.179 | 1.219 | 0,07 |
| 3,500 % fällig am 20.10.2046 - 20.02.2048 (i) | | 16.108 | 16.696 | 1,02 |
| 3,656 % fällig am 16.08.2042 (a) | | 3.371 | 645 | 0,04 |
| 3,717 % fällig am 20.01.2035 (a) | | 4.458 | 654 | 0,04 |
| 3,817 % fällig am 20.03.2035 - 20.09.2048 (a) | | 11.707 | 765 | 0,05 |
| 3,867 % fällig am 20.07.2044 (a) | | 2.278 | 871 | 0,05 |
| 4,000 % fällig am 15.04.2047 - 15.08.2048 | | 3.603 | 3.825 | 0,23 |
| 4,000 % fällig am 15.07.2048 (i) | | 1.316 | 1.415 | 0,09 |
| 4,006 % fällig am 16.01.2038 (a) | | 104 | 11 | 0,00 |
| 4,056 % fällig am 16.02.2040 (a) | | 4.107 | 670 | 0,04 |
| 4,215 % fällig am 20.05.2041 | | 3.676 | 540 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 20.05.2043 (a) | | 1.759 | 189 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 20.04.2048 - 20.03.2049 | | 3.297 | 3.472 | 0,21 |
| 4,500 % fällig am 20.05.2048 - 20.05.2049 (i) | | 86.905 | 90.635 | 5,55 |
| 5,000 % fällig am 20.11.2048 - 20.06.2049 (i) | | 57.829 | 60.657 | 3,72 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 6,000 % fällig am 20.02.2047 | $ | 47 | $ 52 | 0,00 |
| 13,500 % fällig am 20.11.2045 | | 534 | 1.024 | 0,06 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2049 | | 47.300 | 48.277 | 2,96 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | | 5.800 | 5.987 | 0,37 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | | 122.500 | 126.960 | 7,78 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2049 | | 55.000 | 57.303 | 3,51 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2049 | | 33.400 | 34.919 | 2,14 |
| | | | 1.405.640 | 86,14 |

**US-SCHATZOBLIGATIONEN**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)** | | | | |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 (i)(j) | | 94.004 | 98.988 | 6,07 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 1,750 % fällig am 31.03.2022 | | 20 | 20 | 0,00 |
| 1,750 % fällig am 31.05.2022 (i)(k) | | 4.230 | 4.234 | 0,26 |
| 1,875 % fällig am 31.03.2022 (k) | | 4.000 | 4.018 | 0,25 |
| 2,000 % fällig am 31.10.2022 (i) | | 83.540 | 84.282 | 5,16 |
| 2,000 % fällig am 30.11.2022 (i) | | 9.000 | 9.082 | 0,56 |
| 2,250 % fällig am 31.03.2026 (i) | | 7.900 | 8.096 | 0,50 |
| 2,250 % fällig am 15.08.2027 (i) | | 24.300 | 24.894 | 1,53 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2027 (i) | | 2.200 | 2.253 | 0,14 |
| 2,375 % fällig am 31.01.2023 (i) | | 28.900 | 29.550 | 1,81 |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 (i)(j) | | 29.500 | 30.489 | 1,87 |
| 2,625 % fällig am 30.06.2023 (i) | | 25.000 | 25.862 | 1,58 |
| 2,625 % fällig am 31.12.2025 (i) | | 18.600 | 19.482 | 1,19 |
| 2,625 % fällig am 31.01.2026 (i) | | 36.500 | 38.240 | 2,34 |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 (i) | | 18.000 | 18.984 | 1,16 |
| 2,875 % fällig am 30.11.2025 (i) | | 37.000 | 39.302 | 2,41 |
| 3,000 % fällig am 30.09.2025 (i) | | 11.400 | 12.181 | 0,75 |
| | | | 449.957 | 27,58 |

**NON-AGENCY-MBS**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | | |
| 2,529 % fällig am 25.03.2047 | | 4.759 | 4.401 | 0,27 |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | | |
| 2,984 % fällig am 25.11.2045 | | 3.605 | 3.558 | 0,22 |
| 5,383 % fällig am 25.09.2035 | | 936 | 708 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 25.03.2047 | | 2.117 | 2.054 | 0,13 |
| **Ashford Hospitality Trust** | | | | |
| 3,644 % fällig am 15.04.2035 | | 4.000 | 4.002 | 0,25 |
| 3,694 % fällig am 15.05.2035 | | 6.900 | 6.921 | 0,42 |
| 3,994 % fällig am 15.05.2035 | | 6.900 | 6.912 | 0,42 |
| 4,494 % fällig am 15.04.2035 | | 4.000 | 4.024 | 0,25 |
| 5,144 % fällig am 15.05.2035 | | 6.900 | 6.922 | 0,42 |
| **Atrium Hotel Portfolio Trust** | | | | |
| 3,824 % fällig am 15.06.2035 | | 1.400 | 1.404 | 0,09 |
| **Banc of America Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 6,056 % fällig am 10.02.2051 | | 2.742 | 2.817 | 0,17 |
| 6,236 % fällig am 10.02.2051 | | 844 | 796 | 0,05 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | | |
| 2,612 % fällig am 26.05.2037 | | 4.467 | 3.948 | 0,24 |
| 5,763 % fällig am 25.10.2036 | | 3.595 | 3.477 | 0,21 |
| **BCAP LLC Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.04.2037 | | 4.069 | 3.977 | 0,24 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | | |
| 3,529 % fällig am 25.01.2035 | | 1.530 | 1.430 | 0,09 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.06.2037 | | 8.502 | 8.189 | 0,50 |
| **BX Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,144 % fällig am 15.11.2035 | | 2.842 | 2.848 | 0,17 |
| **BX Trust** | | | | |
| 3,594 % fällig am 15.07.2034 | | 1.615 | 1.616 | 0,10 |
| 3,719 % fällig am 15.09.2037 | | 1.588 | 1.586 | 0,10 |
| **BXP Trust** | | | | |
| 3,379 % fällig am 13.06.2039 | | 1.500 | 1.575 | 0,10 |
| **Cascade Funding Mortgage Trust** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.10.2068 | | 2.321 | 2.373 | 0,15 |
| **CD Mortgage Trust** | | | | |
| 5,648 % fällig am 15.10.2048 | | 64 | 67 | 0,00 |
| **CGGS Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,744 % fällig am 15.02.2037 | | 4.000 | 4.008 | 0,25 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | | |
| 4,239 % fällig am 25.03.2037 ^ | | 116 | 116 | 0,01 |
| **ChaseFlex Trust** | | | | |
| 2,744 % fällig am 25.05.2037 | $ | 1.383 | $ 1.316 | 0,08 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,494 % fällig am 15.07.2030 | | 984 | 979 | 0,06 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.12.2035 | | 3.201 | 3.256 | 0,20 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 4,481 % fällig am 25.08.2035 | | 55 | 57 | 0,00 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,954 % fällig am 25.01.2037 | | 2.973 | 2.457 | 0,15 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 | | 1.605 | 1.561 | 0,10 |
| **Civic Mortgage LLC** | | | | |
| 3,892 % fällig am 25.06.2022 | | 958 | 956 | 0,06 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.02.2047 | | 567 | 550 | 0,03 |
| 2,564 % fällig am 25.09.2047 | | 17 | 16 | 0,00 |
| 2,593 % fällig am 20.03.2046 | | 980 | 908 | 0,06 |
| 2,593 % fällig am 20.05.2046 ^ | | 3.287 | 2.777 | 0,17 |
| 2,684 % fällig am 25.10.2046 | | 4.280 | 4.230 | 0,26 |
| 2,724 % fällig am 25.11.2035 | | 8.636 | 8.093 | 0,50 |
| 3,444 % fällig am 25.06.2046 | | 3.590 | 3.260 | 0,20 |
| 3,504 % fällig am 25.12.2035 | | 2.858 | 2.780 | 0,17 |
| 3,884 % fällig am 25.11.2047 ^ | | 7.016 | 6.273 | 0,38 |
| 5,500 % fällig am 25.06.2035 | | 269 | 270 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 25.07.2035 | | 4.049 | 3.870 | 0,24 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 2.993 | 2.644 | 0,16 |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 | | 456 | 433 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 | | 5.642 | 4.764 | 0,29 |
| 6,000 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.945 | 1.301 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 25.05.2036 | | 485 | 380 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 25.09.2037 | | 902 | 835 | 0,05 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,904 % fällig am 25.03.2036 | | 2.349 | 2.245 | 0,14 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,862 % fällig am 25.04.2035 ^ | | 463 | 386 | 0,02 |
| 3,857 % fällig am 20.11.2035 | | 1.984 | 1.816 | 0,11 |
| 4,209 % fällig am 20.04.2036 | | 117 | 110 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.07.2037 ^ | | 1.460 | 1.245 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2037 ^ | | 3.579 | 2.666 | 0,16 |
| 6,500 % fällig am 25.12.2037 | | 6.856 | 5.259 | 0,32 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 4,109 % fällig am 26.02.2036 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | | |
| 2,670 % fällig am 27.05.2037 | | 21 | 21 | 0,00 |
| 3,344 % fällig am 15.02.2031 | | 340 | 339 | 0,02 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.01.2047 | | 9.014 | 7.809 | 0,48 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,580 % fällig am 19.10.2036 | | 11.161 | 9.986 | 0,61 |
| **Dutch Property Finance BV** | | | | |
| 0,368 % fällig am 28.01.2048 | € | 2.687 | 3.066 | 0,19 |
| **Eurosail PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 13.03.2045 | | 550 | 582 | 0,04 |
| 0,127 % fällig am 10.09.2044 | | 800 | 821 | 0,05 |
| 1,789 % fällig am 13.06.2045 | £ | 503 | 600 | 0,04 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 4,273 % fällig am 25.07.2035 | $ | 519 | 514 | 0,03 |
| **GE Capital Commercial Mortgage Corp.** | | | | |
| 5,944 % fällig am 10.11.2045 | | 2.977 | 3.010 | 0,18 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.10.2046 | | 14.441 | 14.169 | 0,87 |
| **GS Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 4,202 % fällig am 10.02.2029 | | 3.100 | 3.123 | 0,19 |
| 4,579 % fällig am 10.10.2032 | | 7.800 | 8.073 | 0,50 |
| **GS Mortgage Securities Corp. Trust** | | | | |
| 3,594 % fällig am 15.07.2031 | | 500 | 500 | 0,03 |
| 3,844 % fällig am 15.07.2031 | | 2.000 | 2.003 | 0,12 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.04.2036 | | 575 | 492 | 0,03 |
| 7,109 % fällig am 20.10.2032 | | 2.066 | 2.134 | 0,13 |
| **GSMSC Resecuritization Trust** | | | | |
| 5,515 % fällig am 26.04.2037 | | 6.471 | 2.307 | 0,14 |
| **Hilton USA Trust** | | | | |
| 4,927 % fällig am 05.11.2035 | | 11.000 | 11.145 | 0,68 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 2,944 % fällig am 25.10.2035 | | 7.184 | 6.904 | 0,42 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 3,364 % fällig am 25.07.2035 | $ | 1.100 | $ 1.082 | 0,07 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,903 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 6.671 | 5.677 | 0,35 |
| 4,134 % fällig am 25.12.2035 | | 661 | 607 | 0,04 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 4,534 % fällig am 15.10.2032 | | 4.100 | 4.095 | 0,25 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 5,337 % fällig am 15.05.2047 | | 8.448 | 7.891 | 0,48 |
| 5,806 % fällig am 12.01.2043 | | 358 | 358 | 0,02 |
| 6,389 % fällig am 12.02.2051 | | 1.252 | 1.265 | 0,08 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 26.04.2037 | | 1.690 | 1.372 | 0,08 |
| 6,025 % fällig am 26.09.2037 | | 1.425 | 1.107 | 0,07 |
| **Lehman Mortgage Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 | | 2.992 | 2.976 | 0,18 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.06.2047 | | 15.631 | 14.175 | 0,87 |
| **MASTR Asset Securitization Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2036 | | 1.428 | 1.438 | 0,09 |
| **MASTR Reperforming Loan Trust** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.07.2035 | | 1.772 | 1.760 | 0,11 |
| **ML-CFC Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,324 % fällig am 12.12.2049 | | 1.591 | 1.289 | 0,08 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.10.2037 | | 12.096 | 10.317 | 0,63 |
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | | |
| 2,880 % fällig am 25.02.2042 | | 1.737 | 1.614 | 0,10 |
| **Motel 6 Trust** | | | | |
| 3,314 % fällig am 15.08.2034 | | 2.818 | 2.822 | 0,17 |
| 3,584 % fällig am 15.08.2034 | | 2.466 | 2.469 | 0,15 |
| 4,544 % fällig am 15.08.2034 | | 264 | 266 | 0,02 |
| **MSCG SELF Trust** | | | | |
| 3,474 % fällig am 15.10.2037 | | 3.400 | 3.408 | 0,21 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.08.2036 | | 1.787 | 1.343 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 338 | 323 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 2.162 | 2.020 | 0,12 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.03.2035 | | 2.939 | 2.623 | 0,16 |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | | 3.134 | 1.600 | 0,10 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,582 % fällig am 20.03.2050 | £ | 1.976 | 2.512 | 0,15 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,763 % fällig am 12.06.2046 | | 4.041 | 5.140 | 0,32 |
| **Sestante Finance SRL** | | | | |
| 0,000 % fällig am 23.07.2046 | € | 1.338 | 1.380 | 0,08 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.02.2037 | $ | 1.239 | 1.195 | 0,07 |
| 2,624 % fällig am 25.06.2037 | | 738 | 714 | 0,04 |
| 4,185 % fällig am 25.05.2035 | | 2.116 | 1.888 | 0,12 |
| 4,566 % fällig am 25.02.2034 | | 25 | 25 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.09.2047 | | 7.176 | 6.965 | 0,43 |
| 2,944 % fällig am 25.08.2035 | | 929 | 916 | 0,06 |
| 3,515 % fällig am 19.12.2033 | | 1.222 | 1.014 | 0,06 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.07.2035 | | 2.226 | 2.100 | 0,13 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.05.2036 | | 3.186 | 2.821 | 0,17 |
| **Sutherland Commercial Mortgage Loans** | | | | |
| 3,192 % fällig am 25.05.2037 | | 1.536 | 1.526 | 0,09 |
| **Twin Bridges PLC** | | | | |
| 1,573 % fällig am 12.09.2044 | £ | 4.584 | 5.814 | 0,36 |
| 1,668 % fällig am 12.09.2050 | | 4.114 | 5.226 | 0,32 |
| **Uropa Securities PLC** | | | | |
| 1,074 % fällig am 10.10.2040 | | 98 | 113 | 0,01 |
| 1,174 % fällig am 10.10.2040 | | 49 | 57 | 0,00 |
| **Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 5,844 % fällig am 15.02.2051 | $ | 990 | 863 | 0,05 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,345 % fällig am 25.01.2047 | | 1.309 | 1.305 | 0,08 |
| 2,595 % fällig am 25.11.2046 | | 536 | 539 | 0,03 |
| 3,274 % fällig am 25.04.2047 ^ | | 134 | 124 | 0,01 |
| 3,464 % fällig am 25.09.2046 | | 1.947 | 1.801 | 0,11 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 5,750 % fällig am 25.05.2036 ^ | $ | 106 | $ 105 | 0,01 |
| | | | 343.061 | 21,02 |

**FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,945 % fällig am 25.09.2035 | | 4.200 | 3.873 | 0,24 |
| 3,424 % fällig am 25.07.2035 | | 2.150 | 2.099 | 0,13 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 3,404 % fällig am 25.03.2035 ^ | | 133 | 129 | 0,01 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,784 % fällig am 25.04.2036 | | 8.500 | 7.745 | 0,47 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.04.2035 | | 6.500 | 6.469 | 0,40 |
| 3,499 % fällig am 25.09.2034 | | 3.079 | 3.024 | 0,19 |
| **Apex Credit CLO Ltd.** | | | | |
| 3,632 % fällig am 27.10.2028 | | 5.600 | 5.607 | 0,34 |
| **Argent Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,884 % fällig am 25.05.2035 | | 4.106 | 3.966 | 0,24 |
| **Argent Securities Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 7.601 | 6.628 | 0,41 |
| 2,594 % fällig am 25.03.2036 | | 6.677 | 6.198 | 0,38 |
| **Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.12.2036 | | 4.731 | 4.211 | 0,26 |
| 3,634 % fällig am 25.02.2035 | | 946 | 888 | 0,05 |
| **Attentus CDO Ltd.** | | | | |
| 3,031 % fällig am 11.10.2042 | | 14.335 | 12.400 | 0,76 |
| **Avery Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,721 % fällig am 18.01.2025 | | 516 | 517 | 0,03 |
| **Bavarian Sky S.A.** | | | | |
| 0,012 % fällig am 20.05.2024 | € | 124 | 141 | 0,01 |
| 0,012 % fällig am 20.10.2024 | | 166 | 189 | 0,01 |
| **Bayview Opportunity Master Fund Trust** | | | | |
| 4,213 % fällig am 29.10.2033 | $ | 280 | 283 | 0,02 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.07.2036 | | 1.700 | 1.644 | 0,10 |
| 3,124 % fällig am 25.12.2035 | | 1.717 | 1.353 | 0,08 |
| 3,454 % fällig am 25.08.2037 | | 17.627 | 15.578 | 0,95 |
| 3,604 % fällig am 25.01.2045 | | 346 | 348 | 0,02 |
| 4,279 % fällig am 25.07.2034 | | 472 | 482 | 0,03 |
| **Benefit Street Partners CLO Ltd.** | | | | |
| 3,381 % fällig am 18.07.2027 | | 500 | 497 | 0,03 |
| **BSPRT Issuer Ltd.** | | | | |
| 3,330 % fällig am 15.03.2028 | | 4.140 | 4.146 | 0,25 |
| 4,830 % fällig am 15.03.2028 | | 2.140 | 2.152 | 0,13 |
| 5,730 % fällig am 15.03.2028 | | 965 | 970 | 0,06 |
| **Business Jet Securities LLC** | | | | |
| 4,447 % fällig am 15.06.2033 | | 14.219 | 14.440 | 0,89 |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | € | 3.400 | 3.883 | 0,24 |
| 0,790 % fällig am 25.07.2029 | | 2.300 | 2.622 | 0,16 |
| **Capitalsource Real Estate Loan Trust** | | | | |
| 2,974 % fällig am 20.01.2037 | $ | 409 | 400 | 0,02 |
| 3,242 % fällig am 20.01.2037 | | 950 | 879 | 0,05 |
| 3,342 % fällig am 20.01.2037 | | 350 | 319 | 0,02 |
| 3,442 % fällig am 20.01.2037 | | 200 | 142 | 0,01 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.** | | | | |
| 0,780 % fällig am 16.04.2029 | € | 1.000 | 1.146 | 0,07 |
| 1,200 % fällig am 16.04.2029 | | 1.000 | 1.153 | 0,07 |
| **Castlelake Aircraft Securitization Trust** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2043 | $ | 7.535 | 7.605 | 0,47 |
| **Centex Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,724 % fällig am 25.06.2036 | | 1.300 | 1.266 | 0,08 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | | |
| 3,377 % fällig am 15.04.2027 | | 3.000 | 2.998 | 0,18 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,930 % fällig am 25.10.2037 | | 880 | 895 | 0,06 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.12.2036 | | 4.911 | 3.343 | 0,21 |
| 2,804 % fällig am 25.03.2037 | | 5.800 | 5.802 | 0,36 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,379 % fällig am 25.05.2035 | | 1.279 | 1.247 | 0,08 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,684 % fällig am 25.11.2036 | | 2.500 | 2.495 | 0,15 |
| **Columbia Cent CLO Ltd.** | | | | |
| 3,730 % fällig am 25.10.2028 | $ | 5.000 | $ 4.996 | 0,31 |
| **Conseco Finance Corp.** | | | | |
| 6,920 % fällig am 01.12.2030 | | 7.941 | 8.771 | 0,54 |
| **Contego CLO BV** | | | | |
| 0,599 % fällig am 15.11.2026 | € | 7.369 | 8.392 | 0,51 |
| **Cork Street CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,590 % fällig am 27.11.2028 | | 4.900 | 5.604 | 0,34 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.04.2047 ^ | $ | 916 | 889 | 0,05 |
| 2,554 % fällig am 25.06.2047 ^ | | 838 | 834 | 0,05 |
| 2,594 % fällig am 25.11.2037 | | 1.320 | 1.312 | 0,08 |
| 2,624 % fällig am 25.09.2037 ^ | | 5.288 | 4.427 | 0,27 |
| 2,634 % fällig am 25.05.2037 | | 7.400 | 6.825 | 0,42 |
| 2,654 % fällig am 25.01.2046 ^ | | 7.093 | 6.823 | 0,42 |
| 2,754 % fällig am 25.03.2036 ^ | | 2.456 | 2.258 | 0,14 |
| 2,754 % fällig am 25.04.2036 | | 1.848 | 1.850 | 0,11 |
| 3,054 % fällig am 25.01.2036 | | 100 | 96 | 0,01 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 3,034 % fällig am 25.08.2035 | | 1.087 | 1.090 | 0,07 |
| 3,379 % fällig am 25.10.2034 | | 136 | 136 | 0,01 |
| 4,309 % fällig am 25.08.2034 | | 525 | 527 | 0,03 |
| 5,633 % fällig am 25.06.2035 | | 92 | 97 | 0,01 |
| 5,859 % fällig am 25.10.2046 ^ | | 59 | 56 | 0,00 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.05.2036 | | 3.154 | 2.667 | 0,16 |
| 3,184 % fällig am 25.03.2034 | | 552 | 557 | 0,03 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,028 % fällig am 25.02.2037 | | 4.395 | 3.533 | 0,22 |
| **CVP Cascade CLO Ltd.** | | | | |
| 3,751 % fällig am 16.01.2026 | | 515 | 515 | 0,03 |
| **CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 15.02.2036 | | 5.036 | 4.899 | 0,30 |
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | € | 4.100 | 4.675 | 0,29 |
| **Denali Capital CLO LLC** | | | | |
| 3,636 % fällig am 26.10.2027 | $ | 3.820 | 3.816 | 0,23 |
| **Dorchester Park CLO DAC** | | | | |
| 3,492 % fällig am 20.04.2028 | | 10.000 | 9.938 | 0,61 |
| **Driver Australia Four Trust** | | | | |
| 2,185 % fällig am 21.08.2025 | AUD | 506 | 355 | 0,02 |
| **Driver Espana** | | | | |
| 0,009 % fällig am 21.12.2028 | € | 2.251 | 2.574 | 0,16 |
| **Dryden Euro CLO BV** | | | | |
| 0,718 % fällig am 17.05.2027 | | 973 | 1.109 | 0,07 |
| **ECMC Group Student Loan Trust** | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.05.2067 | $ | 1.504 | 1.504 | 0,09 |
| **Evans Grove CLO Ltd.** | | | | |
| 3,441 % fällig am 28.05.2028 | | 17.700 | 17.604 | 1,08 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.11.2036 | | 14.567 | 14.297 | 0,88 |
| 2,714 % fällig am 25.09.2036 | | 7.465 | 6.888 | 0,42 |
| 2,844 % fällig am 25.01.2036 | | 1.550 | 1.543 | 0,09 |
| **Flagship Ltd.** | | | | |
| 3,712 % fällig am 20.01.2026 | | 117 | 117 | 0,01 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | |
| 2,544 % fällig am 25.02.2037 | | 9.572 | 7.414 | 0,45 |
| 3,334 % fällig am 25.07.2035 | | 4.000 | 3.492 | 0,21 |
| **Goodgreen Trust** | | | | |
| 3,930 % fällig am 15.10.2053 | | 6.549 | 6.837 | 0,42 |
| **Greystone Commercial Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,944 % fällig am 15.03.2027 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | | |
| 2,634 % fällig am 25.04.2047 | | 6.083 | 4.081 | 0,25 |
| 2,884 % fällig am 25.10.2035 | | 1.908 | 1.786 | 0,11 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 3,289 % fällig am 25.07.2045 ^ | | 3.976 | 3.896 | 0,24 |
| **Harley Marine Financing LLC** | | | | |
| 5,682 % fällig am 15.05.2043 | | 1.639 | 1.359 | 0,08 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 250 | 285 | 0,02 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.02.2036 | $ | 1.400 | 1.373 | 0,08 |
| 3,694 % fällig am 25.08.2033 | | 748 | 752 | 0,05 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.08.2036 | | 7.500 | 6.801 | 0,42 |
| 2,644 % fällig am 25.04.2037 | $ | 12.350 | $ 9.455 | 0,58 |
| 3,649 % fällig am 25.03.2035 | | 2.900 | 2.978 | 0,18 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.05.2037 | | 4.600 | 4.386 | 0,27 |
| **Jamestown CLO Ltd.** | | | | |
| 3,467 % fällig am 15.01.2028 | | 12.800 | 12.761 | 0,78 |
| 3,808 % fällig am 17.01.2027 | | 980 | 982 | 0,06 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.03.2036 | | 6.153 | 5.663 | 0,35 |
| 2,834 % fällig am 25.10.2035 | | 4.900 | 4.384 | 0,27 |
| 3,424 % fällig am 25.07.2035 | | 3.587 | 3.632 | 0,22 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.12.2036 | | 7.847 | 5.095 | 0,31 |
| 2,614 % fällig am 25.03.2037 | | 1.490 | 1.491 | 0,09 |
| 2,644 % fällig am 25.11.2036 | | 313 | 273 | 0,02 |
| 2,674 % fällig am 25.07.2036 | | 12.500 | 12.149 | 0,74 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | |
| 0,530 % fällig am 12.07.2028 | € | 480 | 547 | 0,03 |
| **LCM LP** | | | | |
| 3,632 % fällig am 20.10.2027 | $ | 1.000 | 1.000 | 0,06 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 | | 4.043 | 3.917 | 0,24 |
| 2,614 % fällig am 25.06.2046 | | 8.211 | 8.093 | 0,50 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.02.2036 | | 190 | 166 | 0,01 |
| **M360 Advisors LLC** | | | | |
| 6,121 % fällig am 24.07.2028 | | 11.750 | 11.890 | 0,73 |
| **Magnetite Ltd.** | | | | |
| 3,580 % fällig am 25.07.2026 | | 3.540 | 3.543 | 0,22 |
| **MAPS Ltd.** | | | | |
| 4,212 % fällig am 15.05.2043 | | 3.641 | 3.735 | 0,23 |
| **Marlette Funding Trust** | | | | |
| 3,060 % fällig am 17.07.2028 | | 796 | 797 | 0,05 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,974 % fällig am 25.01.2036 | | 5.038 | 4.985 | 0,31 |
| 2,984 % fällig am 25.12.2035 | | 1.676 | 1.679 | 0,10 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.12.2036 | | 5.000 | 4.282 | 0,26 |
| 3,484 % fällig am 25.10.2035 | | 1.219 | 1.217 | 0,07 |
| **MidOcean Credit CLO** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.04.2027 | | 18.300 | 18.251 | 1,12 |
| **Monarch Grove CLO** | | | | |
| 3,460 % fällig am 25.01.2028 | | 2.700 | 2.689 | 0,17 |
| **Monroe Capital BSL CLO Ltd.** | | | | |
| 3,643 % fällig am 22.05.2027 | | 1.000 | 1.000 | 0,06 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,529 % fällig am 25.07.2036 | | 21.250 | 18.633 | 1,14 |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 4.415 | 2.223 | 0,14 |
| 2,654 % fällig am 25.07.2036 | | 4.415 | 2.282 | 0,14 |
| 2,784 % fällig am 25.12.2035 | | 9.210 | 8.046 | 0,49 |
| **Morgan Stanley Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 2,694 % fällig am 25.01.2036 | | 4.299 | 4.259 | 0,26 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,504 % fällig am 25.04.2037 | | 192 | 129 | 0,01 |
| **Munda CLO BV** | | | | |
| 0,613 % fällig am 05.12.2024 | € | 278 | 317 | 0,02 |
| **National Collegiate Student Loan Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.07.2030 | $ | 50 | 50 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 26.03.2029 | | 440 | 438 | 0,03 |
| 2,674 % fällig am 25.09.2029 | | 3 | 3 | 0,00 |
| 2,714 % fällig am 25.05.2032 | | 9.993 | 9.525 | 0,58 |
| **Navient Private Education Loan Trust** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.12.2028 | | 403 | 405 | 0,02 |
| 2,740 % fällig am 15.02.2029 | | 59 | 60 | 0,00 |
| **Neuberger Berman CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | | 2.100 | 2.098 | 0,13 |
| **North Westerly CLO BV** | | | | |
| 0,644 % fällig am 15.01.2026 | € | 3.011 | 3.430 | 0,21 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 3,600 % fällig am 25.06.2035 | $ | 2.000 | 1.982 | 0,12 |
| **Ocean Trails CLO** | | | | |
| 3,435 % fällig am 13.08.2025 | | 2.035 | 2.037 | 0,13 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | | 1.400 | 1.397 | 0,09 |
| **OFSI Fund Ltd.** | | | | |
| 3,247 % fällig am 20.03.2025 | | 609 | 609 | 0,04 |
| 3,501 % fällig am 18.10.2026 | | 3.457 | 3.454 | 0,21 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.03.2037 | $ 11.062 | $ 10.132 | 0,62 |
| **Palmer Square Loan Funding Ltd.** | | | |
| 3,247 % fällig am 15.07.2026 | 10.908 | 10.846 | 0,66 |
| 3,647 % fällig am 15.07.2026 | 4.600 | 4.553 | 0,28 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 2,894 % fällig am 25.09.2035 | 5.100 | 5.101 | 0,31 |
| 2,924 % fällig am 25.09.2035 | 7.700 | 6.874 | 0,42 |
| 3,979 % fällig am 25.02.2035 | 600 | 613 | 0,04 |
| 4,054 % fällig am 25.12.2034 | 4.419 | 4.494 | 0,28 |
| 4,279 % fällig am 25.09.2034 | 1.692 | 1.708 | 0,10 |
| **Penta CLO BV** | | | |
| 0,790 % fällig am 04.08.2028 | € 3.500 | 3.989 | 0,24 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,654 % fällig am 25.06.2047 ^ | $ 1.702 | 1.680 | 0,10 |
| 2,734 % fällig am 25.07.2036 | 4.100 | 3.885 | 0,24 |
| 2,764 % fällig am 25.05.2036 ^ | 670 | 627 | 0,04 |
| 2,794 % fällig am 25.02.2036 | 3.930 | 3.923 | 0,24 |
| 2,864 % fällig am 25.09.2035 ^ | 634 | 638 | 0,04 |
| **RAAC Trust** | | | |
| 2,804 % fällig am 25.06.2047 | 132 | 133 | 0,01 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 2,764 % fällig am 25.02.2036 | 200 | 190 | 0,01 |
| 3,104 % fällig am 25.08.2035 | 1.363 | 1.359 | 0,08 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.02.2037 | 11.000 | 10.459 | 0,64 |
| 2,644 % fällig am 25.10.2036 | 4.552 | 4.482 | 0,27 |
| 2,664 % fällig am 25.07.2036 | 4.832 | 4.758 | 0,29 |
| 2,694 % fällig am 25.06.2036 | 1.400 | 1.347 | 0,08 |
| 3,094 % fällig am 25.11.2035 | 1.555 | 1.549 | 0,10 |
| 3,184 % fällig am 25.06.2034 | 453 | 452 | 0,03 |
| 3,349 % fällig am 25.05.2035 | 1.110 | 1.112 | 0,07 |
| **Sapphire Aviation Finance Ltd.** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.03.2040 | 14.420 | 14.631 | 0,90 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | |
| 2,844 % fällig am 25.11.2037 | 1.371 | 1.376 | 0,08 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | |
| 2,520 % fällig am 15.03.2027 | 1.769 | 1.762 | 0,11 |
| 2,618 % fällig am 15.02.2025 | 203 | 203 | 0,01 |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | |
| 4,644 % fällig am 16.06.2042 | 400 | 405 | 0,02 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2023 | € 21 | 24 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 25.01.2024 | € 184 | $ 210 | 0,01 |
| 0,000 % fällig am 17.06.2024 | 116 | 132 | 0,01 |
| 2,680 % fällig am 25.04.2027 | $ 1.087 | 1.085 | 0,07 |
| 2,690 % fällig am 27.01.2025 | 278 | 277 | 0,02 |
| 2,690 % fällig am 27.10.2025 | 488 | 487 | 0,03 |
| 3,610 % fällig am 15.12.2033 | 3.758 | 3.756 | 0,23 |
| **SoFi Consumer Loan Program LLC** | | | |
| 2,500 % fällig am 26.05.2026 | 285 | 285 | 0,02 |
| 2,770 % fällig am 25.05.2026 | 353 | 354 | 0,02 |
| 3,260 % fällig am 25.08.2025 | 82 | 83 | 0,01 |
| **SoFi Professional Loan Program LLC** | | | |
| 2,650 % fällig am 25.09.2040 | 300 | 303 | 0,02 |
| **Sorin Real Estate CDO Ltd.** | | | |
| 3,087 % fällig am 07.06.2040 | 3.242 | 3.245 | 0,20 |
| **Sorrento Park CLO DAC** | | | |
| 0,639 % fällig am 16.11.2027 | € 1.354 | 1.543 | 0,09 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.07.2037 | $ 12.821 | 10.853 | 0,67 |
| 2,574 % fällig am 25.08.2037 | 13.515 | 12.467 | 0,76 |
| 3,304 % fällig am 25.10.2037 | 13.982 | 11.710 | 0,72 |
| 3,704 % fällig am 25.10.2037 | 10.700 | 9.062 | 0,56 |
| **Spirit Master Funding LLC** | | | |
| 4,360 % fällig am 20.12.2047 | 12.195 | 12.667 | 0,78 |
| **Sprite Ltd.** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.12.2037 | 1.756 | 1.802 | 0,11 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 3,304 % fällig am 25.05.2035 | 4.200 | 4.244 | 0,26 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,534 % fällig am 25.05.2036 | 840 | 810 | 0,05 |
| 2,714 % fällig am 25.08.2046 | 8.572 | 7.951 | 0,49 |
| 3,154 % fällig am 25.04.2035 | 195 | 189 | 0,01 |
| **Taberna Preferred Funding Ltd.** | | | |
| 2,905 % fällig am 05.05.2038 | 11.911 | 11.375 | 0,70 |
| 3,068 % fällig am 05.07.2035 | 600 | 549 | 0,03 |
| **Terwin Mortgage Trust** | | | |
| 3,034 % fällig am 25.06.2036 | 200 | 183 | 0,01 |
| **Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.** | | | |
| 4,147 % fällig am 15.09.2038 | 12.871 | 13.156 | 0,81 |
| **TICP CLO Ltd.** | | | |
| 3,392 % fällig am 20.07.2027 | 1.000 | 997 | 0,06 |
| 3,601 % fällig am 20.04.2028 | 17.950 | 17.802 | 1,09 |
| **Tralee CLO Ltd.** | | | |
| 3,702 % fällig am 20.10.2028 | 5.000 | 4.987 | 0,31 |
| **TruPS Financials Note Securitization Ltd.** | | | |
| 3,957 % fällig am 20.09.2039 | $ 5.289 | $ 5.236 | 0,32 |
| **Upstart Securitization Trust** | | | |
| 3,887 % fällig am 20.08.2025 | 1.852 | 1.856 | 0,11 |
| 4,997 % fällig am 20.08.2025 | 1.300 | 1.319 | 0,08 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | |
| 3,321 % fällig am 28.02.2026 | 12.396 | 12.362 | 0,76 |
| 3,447 % fällig am 15.01.2028 | 10.200 | 10.172 | 0,62 |
| 3,477 % fällig am 15.04.2027 | 4.100 | 4.090 | 0,25 |
| 3,667 % fällig am 15.04.2027 | 2.100 | 2.095 | 0,13 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | |
| 3,300 % fällig am 25.07.2026 | 2.863 | 2.861 | 0,18 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,614 % fällig am 25.03.2037 | 3.759 | 3.610 | 0,22 |
| 2,724 % fällig am 25.07.2036 | 8.595 | 8.025 | 0,49 |
| 2,744 % fällig am 25.05.2036 | 4.000 | 3.955 | 0,24 |
| **WhiteHorse Ltd.** | | | |
| 3,518 % fällig am 17.04.2027 | 8.400 | 8.387 | 0,51 |
| 3,748 % fällig am 17.07.2026 | 2.210 | 2.212 | 0,14 |
| **Zais CLO Ltd.** | | | |
| 3,747 % fällig am 15.04.2028 | 2.200 | 2.205 | 0,14 |
| | | 808.593 | 49,56 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (i)** | | | |
| | | 1.103 | 0,07 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 1.103 | 0,07 |
| **AKTIEN** | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)** | 6.372.692 | 63.822 | 3,91 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 3.104.843** | **190,28** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar December Futures | Short | 12/2019 | 2.044 | $ (5.523) | (0,34) |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2020 | 154 | (531) | (0,03) |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2020 | 819 | (2.647) | (0,16) |
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2021 | 4.881 | (19.401) | (1,19) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 534 | (1.439) | (0,09) |
| | | | | $ (29.541) | (1,81) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (29.541)** | **(1,81)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 21.06.2024 | $ 1.600 | $ (71) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 20.06.2020 | 141.300 | (2.512) | (0,15) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 20.06.2023 | 67.900 | (3.702) | (0,23) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 11.07.2019 | 128.600 | (793) | (0,05) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 43.900 | (7.488) | (0,46) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,650 | 10.06.2029 | 67.100 | (3.723) | (0,23) |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Mortgage Opportunities Fund (Forts.)

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,697 % | 04.01.2029 | $ 12.400 | $ 914 | 0,06 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2020 | 44.000 | (724) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2023 | 58.100 | (3.238) | (0,20) |
| Zahlung[1] | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 18.12.2026 | 9.900 | 17 | 0,00 |
| Erhalt[1] | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 18.12.2029 | 6.600 | 28 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 20.12.2047 | 41.750 | (2.830) | (0,17) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,915 | 09.07.2028 | 3.500 | 321 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,916 | 02.07.2028 | 6.100 | 559 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,920 | 16.07.2028 | 4.600 | 424 | 0,03 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,924 | 02.07.2028 | 45.300 | 4.185 | 0,26 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,945 | 17.12.2028 | 13.100 | 1.160 | 0,07 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,987 | 12.06.2028 | 51.100 | 4.571 | 0,28 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 11.700 | (40) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2026 | 219.800 | (8.051) | (0,49) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 11.400 | (584) | (0,04) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,100 | 17.12.2028 | 3.200 | 323 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,113 | 21.11.2028 | 34.000 | 3.505 | 0,21 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,120 | 17.12.2028 | 2.600 | 267 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,142 | 20.11.2028 | 16.700 | 1.764 | 0,11 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,177 | 01.11.2028 | 12.700 | 1.380 | 0,08 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,183 | 16.10.2028 | 24.300 | 2.653 | 0,16 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,228 | 25.10.2028 | 2.900 | 328 | 0,02 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,260 | 23.10.2028 | 34.300 | 3.978 | 0,24 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,265 | 23.10.2028 | 12.800 | 1.490 | 0,09 |
| Erhalt[1] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | € 2.400 | (157) | (0,01) |
| Erhalt[1] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | £ 500 | (51) | 0,00 |
| | | | | | $ (6.097) | (0,37) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (6.097)** | **(0,37)** |

[1] Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

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

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

**OPTIONSKAUF**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,790 % | 27.08.2019 | 259.500 | $ 169 | $ 0 | 0,00 |
| CBK | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,400 | 19.05.2027 | 13.900 | 78 | 40 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,790 | 20.09.2019 | 259.500 | 148 | 1 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,790 | 22.08.2019 | 779.000 | 623 | 1 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,550 | 30.09.2019 | 73.500 | 55 | 1 | 0,00 |
| GLM | Put - OTC 1-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,400 | 19.05.2027 | 20.000 | 107 | 58 | 0,01 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,250 | 05.08.2019 | 54.000 | 55 | 534 | 0,03 |
| | | | | | | | $ 1.235 | $ 635 | 0,04 |

**OPTIONEN AUF WERTPAPIERE**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FAR | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | $ 67,500 | 05.09.2019 | 20.000 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |
| SAL | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 65,000 | 05.09.2019 | 6.000 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 69,000 | 05.09.2019 | 30.000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 70,000 | 05.09.2019 | 58.000 | 2 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 73,000 | 08.07.2019 | 143.000 | 6 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 71,000 | 06.08.2019 | 15.000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2049 | 69,000 | 05.09.2019 | 31.000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.09.2049 | 77,000 | 05.09.2019 | 70.000 | 3 | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 125,000 | 08.07.2019 | 22.000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2049 | 77,000 | 08.07.2019 | 5.000 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 5,000 % fällig am 01.07.2049 | 80,000 | 08.07.2019 | 40.000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 5,000 % fällig am 01.08.2049 | 75,000 | 06.08.2019 | 20.000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Ginnie Mae, TBA 3.000 % fällig am 01.08.2049 | 69,000 | 14.08.2019 | 34.000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Ginnie Mae, TBA 4.000 % fällig am 01.07.2049 | 75,000 | 15.07.2019 | 70.000 | 3 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Ginnie Mae, TBA 4.000 % fällig am 01.08.2049 | 70,000 | 14.08.2019 | 21.000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Ginnie Mae, TBA 4.000 % fällig am 01.08.2049 | 73,000 | 14.08.2019 | 31.000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Ginnie Mae, TBA 4.500 % fällig am 01.08.2049 | 74,000 | 14.08.2019 | 50.000 | 2 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Ginnie Mae, TBA 5.000 % fällig am 01.08.2049 | 71,000 | 14.08.2019 | 33.000 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 27 | $ 0 | 0,00 |

## VERKAUFSOPTIONEN

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 % | 27.08.2019 | 259.500 | $ (30) | $ 0 | 0,00 |
| CBK | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 20.09.2019 | 259.500 | (26) | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 22.08.2019 | 779.000 | (103) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,800 | 30.09.2019 | 73.500 | (11) | 0 | 0,00 |
| FBF | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,250 | 02.01.2020 | 31.500 | (260) | (3) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,500 | 05.08.2019 | 54.000 | (111) | (797) | (0,05) |
| MYC | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,250 | 21.01.2020 | 29.500 | (271) | (4) | 0,00 |
| | | | | | | | $ (812) | $ (804) | (0,05) |

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FAR | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | $ 101,758 | 05.09.2019 | 5.000 | $ (8) | $ (10) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 99,016 | 06.08.2019 | 7.000 | (13) | 4 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 99,359 | 06.08.2019 | 5.000 | (12) | (4) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 101,016 | 06.08.2019 | 7.000 | (9) | (25) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 101,359 | 06.08.2019 | 5.000 | (10) | (11) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 98,758 | 05.09.2019 | 5.000 | (10) | (6) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 99,336 | 05.09.2019 | 5.000 | (15) | (9) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 99,762 | 05.09.2019 | 7.000 | (20) | (19) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 101,336 | 05.09.2019 | 5.000 | (12) | (16) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 101,172 | 08.07.2019 | 5.000 | (8) | (54) | (0,01) |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 101,672 | 08.07.2019 | 4.000 | (3) | (24) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 99,938 | 06.08.2019 | 8.000 | (13) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 101,141 | 06.08.2019 | 15.500 | (65) | (8) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 101,418 | 06.08.2019 | 6.000 | (12) | (5) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 101,938 | 06.08.2019 | 8.000 | (10) | (39) | (0,01) |
| GSC | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 100,242 | 05.09.2019 | 7.000 | (30) | (29) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 101,000 | 06.08.2019 | 17.000 | (73) | (7) | 0,00 |
| JPM | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 99,547 | 05.09.2019 | 5.500 | (14) | (13) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.07.2049 | 100,000 | 08.07.2019 | 4.500 | (9) | (40) | (0,01) |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 99,801 | 06.08.2019 | 7.000 | (25) | (10) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 99,813 | 06.08.2019 | 11.000 | (33) | (17) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 99,906 | 06.08.2019 | 11.000 | (41) | (19) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 100,832 | 06.08.2019 | 7.500 | (26) | (33) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 98,609 | 05.09.2019 | 6.500 | (13) | (6) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 101,609 | 05.09.2019 | 6.500 | (9) | (15) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 98,000 | 08.07.2019 | 4.500 | (11) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 99,766 | 08.07.2019 | 9.000 | (12) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 101,625 | 08.07.2019 | 6.000 | (6) | (39) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 101,766 | 08.07.2019 | 9.000 | (9) | (46) | (0,01) |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 99,984 | 06.08.2019 | 4.000 | (6) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 100,156 | 06.08.2019 | 6.000 | (8) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 100,234 | 06.08.2019 | 4.000 | (5) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 100,375 | 06.08.2019 | 7.500 | (8) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 101,035 | 06.08.2019 | 11.500 | (28) | (5) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 101,984 | 06.08.2019 | 4.000 | (4) | (18) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 101,988 | 06.08.2019 | 6.000 | (12) | (28) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 102,156 | 06.08.2019 | 6.000 | (7) | (21) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 102,234 | 06.08.2019 | 4.000 | (4) | (13) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 102,375 | 06.08.2019 | 7.500 | (7) | (18) | 0,00 |
| SAL | Put - OTC Fannie Mae 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 99,891 | 06.08.2019 | 11.500 | (43) | (19) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 100,844 | 06.08.2019 | 8.000 | (29) | (35) | 0,00 |
| | Call - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 101,766 | 08.07.2019 | 4.000 | (4) | (20) | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 100,656 | 06.08.2019 | 16.000 | (38) | (3) | 0,00 |
| | | | | | $ (734) | $ (689) | (0,04) |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 % | 17.11.2059 | $ 2.900 | $ (68) | $ 91 | $ 23 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 9.500 | (44) | 82 | 38 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 7.000 | (101) | 173 | 72 | 0,01 |
| FBF | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 8.200 | (43) | 76 | 33 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 2.600 | (18) | 14 | (4) | 0,00 |
| GST | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 7.100 | (3) | 60 | 57 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 4.800 | (26) | 45 | 19 | 0,00 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 30.000 | (82) | 323 | 241 | 0,02 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 40.100 | (343) | 503 | 160 | 0,01 |
| SAL | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 4.400 | (89) | 124 | 35 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 92.600 | (592) | 961 | 369 | 0,02 |
| | | | | | $ (1.409) | $ 2.452 | $ 1.043 | 0,06 |

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

## ZINSSWAPS

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPS | Erhalt | 3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread | 0,605 % | 20.12.2019 | $ 65.000 | $ 0 | $ 61 | $ 61 | 0,00 |
| | Erhalt | 3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread | 0,708 | 19.12.2019 | 35.000 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | Erhalt | 3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread | 0,730 | 19.12.2019 | 35.000 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | Erhalt | 3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread | 0,740 | 18.12.2019 | 65.000 | 0 | (26) | (26) | 0,00 |
| | Erhalt | 3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread | 0,753 | 18.12.2019 | 190.000 | 0 | (99) | (99) | (0,01) |
| | Erhalt | 3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread | 0,765 | 03.12.2019 | 76.000 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | Erhalt | 3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread | 0,770 | 05.12.2019 | 165.000 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| SAL | Erhalt | 3-Month MTGEFNCL versus USSW10 Index Spread | 0,784 | 16.08.2019 | 55.000 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | | | | | | $ 0 | $ (128) | $ (128) | (0,01) |

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES UND WERTPAPIERE

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/(erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/(-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPS | Zahlung | IOS.FN.600.08 Index | k. A. | 01-Month USD-LIBOR | $ 1.964 | 12.01.2039 | $ 1 | $ (8) | $ (7) | 0,00 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/(-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | $ | 1.102 | £ | 869 | $ 4 | $ 0 | $ 4 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 479 | $ | 333 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 53.728 | € | 47.275 | 109 | 0 | 109 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 23.305 | £ | 18.342 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 47.275 | $ | 53.865 | 0 | (109) | (109 | (0,01) |
| | 08/2019 | £ | 18.342 | | 23.341 | 0 | (39) | (39 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | € | 56 | | 64 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 24.674 | € | 21.702 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | € | 708 | $ | 798 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 46.567 | | 52.198 | 0 | (832) | (832) | (0,05) |
| | 07/2019 | £ | 19.211 | | 24.327 | 0 | (123) | (123) | (0,01) |
| | | | | | | $ 191 | $ (1.114) | $ (923) | (0,06) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional BRL (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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | 07/2019 | BRL | 5.824 | $ | 1.524 | $ 5 | $ 0 | $ 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.427 | BRL | 5.772 | 79 | 0 | 79 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.519 | | 5.824 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | BRL | 5.824 | $ | 1.524 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 27 | BRL | 108 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.519 | | 5.824 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 1.477 | | 5.911 | 65 | 0 | 65 | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | | 1.426 | | 5.772 | 80 | 0 | 80 | 0,01 |
| RYL | 07/2019 | BRL | 5.739 | $ | 1.501 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.497 | BRL | 5.739 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | BRL | 176 | $ | 46 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 46 | BRL | 176 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 238 | $ (12) | $ 226 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ 19.197 | CHF 19.247 | $ 543 | $ 0 | $ 543 | 0,04 |
| BPS | 07/2019 | CHF 621 | $ 624 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 580 | CHF 574 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF 20.138 | $ 20.566 | 0 | (89) | (89) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 19.170 | CHF 19.208 | 531 | 0 | 531 | 0,03 |
| | 08/2019 | 20.625 | 20.138 | 90 | 0 | 90 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | 18.787 | 18.901 | 599 | 0 | 599 | 0,04 |
| HUS | 07/2019 | CHF 20.137 | $ 20.611 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 81 | CHF 79 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | 20.671 | 20.137 | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 921 | 913 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | CHF 47 | $ 48 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 1.790 | CHF 1.781 | 37 | 0 | 37 | 0,00 |
| | | | | $ 1.866 | $ (143) | $ 1.723 | 0,11 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) thesaurierend, Class E EUR (Hedged) ausschüttend 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 | 07/2019 | € 108.179 | $ 122.934 | $ 0 | $ (260) | $ (260) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ 123.248 | € 108.179 | 261 | 0 | 261 | 0,02 |
| BPS | 07/2019 | € 109.533 | $ 124.513 | 0 | (223) | (223) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 1.266 | € 1.118 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | 121.847 | 106.893 | 194 | 0 | 194 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | 120.532 | 107.773 | 2.200 | 0 | 2.200 | 0,13 |
| CBK | 07/2019 | € 108.179 | $ 122.945 | 0 | (249) | (249) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ 1.801 | € 1.583 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | 123.259 | 108.179 | 250 | 0 | 250 | 0,02 |
| GLM | 07/2019 | 118.906 | 106.543 | 2.427 | 0 | 2.427 | 0,15 |
| MYI | 07/2019 | 120.512 | 107.773 | 2.220 | 0 | 2.220 | 0,14 |
| RBC | 07/2019 | € 91 | $ 103 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | 233 | 263 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 229 | € 202 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € 211 | $ 239 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 1.625 | € 1.448 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € 115 | $ 129 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 113 | € 100 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 7.589 | $ (739) | $ 6.850 | 0,42 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Class Z 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 | 07/2019 | £ 459 | $ 583 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 842 | £ 668 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 84.803 | $ 107.561 | 0 | (369) | (369) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ 582 | £ 459 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | 107.725 | 84.803 | 372 | 0 | 372 | 0,02 |
| CBK | 07/2019 | £ 84.547 | $ 107.425 | 0 | (178) | (178) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 106.432 | £ 84.000 | 475 | 0 | 475 | 0,03 |
| | 08/2019 | 107.590 | 84.547 | 181 | 0 | 181 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | 1.220 | 965 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 210 | 166 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 106.319 | 84.000 | 588 | 0 | 588 | 0,03 |
| SSB | 07/2019 | 104.253 | 82.508 | 755 | 0 | 755 | 0,05 |
| | | | | $ 2.391 | $ (548) | $ 1.843 | 0,11 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | SGD 2.042 | $ 1.508 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 1.490 | SGD 2.056 | 30 | 0 | 30 | 0,01 |
| | 08/2019 | 1.513 | 2.048 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | 1.490 | 2.047 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| DUB | 07/2019 | 1.489 | 2.050 | 26 | 0 | 26 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | SGD 2.049 | $ 1.513 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 1.518 | SGD 2.054 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SGD 2.054 | $ 1.514 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 1.504 | SGD 2.039 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | 1.469 | 2.024 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SGD 2.042 | $ 1.510 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 8 | SGD 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | 1.515 | 2.047 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 112 | $ (7) | $ 105 | 0,01 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 9.874** | **0,60** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2034 (h) | $ 8.500 | $ (8.774) | (0,54) |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 (h) | 29.000 | (29.966) | (1,84) |
| 4,500 % fällig am 01.08.2049 | 43.700 | (45.658) | (2,80) |
| 5,500 % fällig am 01.07.2049 | 5.000 | (5.334) | (0,33) |
| **Freddie Mac, TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 5.000 | (5.171) | (0,32) |
| 4,500 % fällig am 01.07.2049 | 1.500 | (1.569) | (0,09) |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.09.2049 | 9.000 | (9.175) | (0,56) |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 1.500 | (1.564) | (0,09) |
| 4,500 % fällig am 01.07.2049 | 2.000 | (2.085) | (0,13) |
| | | (109.296) | (6,70) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (109.296)** | **(6,70)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 2.969.783** | **182,00** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (1.338.025)** | **(82,00)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 1.631.758** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Reines Kapitalwertpapier.

(c) Nullkuponwertpapier.

(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 30. Juni 2019 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 749.344 als Sicherheiten verpfändet.

(j) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 17.128 als Sicherheiten verpfändet.

(k) Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 6.689 und Barmittel in Höhe von USD 25.207 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsengehandelte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.297 und Barmittel in Höhe von USD 4.472 als Sicherheiten erhalten.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 1.422 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(l) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 819 | U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2021 | $ (836) | $ 819 | $ 819 | 0,05 |
| | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 284 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | (295) | 284 | 284 | 0,02 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.131)** | **$ 1.103** | **$ 1.103** | **0,07** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 63.822 | $ 3.039.662 | $ 1.359 | $ 3.104.843 |
| Finanzderivate[3] | (29.541) | 3.777 | 0 | (25.764) |
| Leerverkäufe | 0 | (109.296) | 0 | (109.296) |
| **Summen** | **$ 34.281** | **$ 2.934.143** | **$ 1.359** | **$ 2.969.783** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 8.355 | $ 3.584.653 | $ 44.869 | $ 3.637.877 |
| Finanzderivate[3] | (16.211) | (830) | 0 | (17.041) |
| Leerverkäufe | 0 | (1.078.788) | 0 | (1.078.788) |
| **Summen** | **$ (7.856)** | **$ 2.505.035** | **$ 44.869** | **$ 2.542.048** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Verbindlich-keiten aus Pensions-geschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,700 % | 17.06.2019 | 01.07.2019 | $ (6.340) | $ (6.346) | (0,39) |
| | 2,780 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | (1.068) | (1.068) | (0,06) |
| | 1,850 | 25.06.2019 | 09.07.2019 | (22.770) | (22.777) | (1,40) |
| | 2,520 | 18.06.2019 | 09.07.2019 | (19.013) | (19.030) | (1,17) |
| | 2,570 | 14.06.2019 | 08.08.2019 | (27.389) | (27.422) | (1,68) |
| | 2,640 | 13.06.2019 | 15.07.2019 | (238.125) | (238.439) | (14,61) |
| | 2,640 | 14.06.2019 | 16.07.2019 | (10.256) | (10.269) | (0,63) |
| | 2,640 | 17.06.2019 | 17.07.2019 | (16.969) | (16.986) | (1,04) |
| | 2,690 | 13.06.2019 | 15.07.2019 | (1.995) | (1.998) | (0,12) |
| | 2,750 | 21.06.2019 | 02.07.2019 | (13.498) | (13.508) | (0,83) |
| CIB | 2,600 | 07.06.2019 | 17.07.2019 | (39.081) | (39.149) | (2,40) |
| RCY | 2,720 | 20.06.2019 | 22.07.2019 | (55.519) | (55.565) | (3,40) |
| SCX | 2,570 | 15.05.2019 | 15.07.2019 | (65.684) | (65.905) | (4,04) |
| | 2,590 | 24.04.2019 | 24.07.2019 | (81.795) | (82.195) | (5,04) |
| | 2,600 | 17.04.2019 | 17.07.2019 | (48.628) | (48.892) | (3,00) |
| | 2,610 | 25.06.2019 | 06.08.2019 | (28.754 | (28.766) | (1,76) |
| | 2,650 | 24.06.2019 | 08.07.2019 | (57.990) | (58.020) | (3,56) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (736.335)** | **(45,13)** |

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-geschäfte[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,050 % | 27.06.2019 | 05.07.2019 | $ (7.746) | $ (7.747) | (0,48) |
| BPG | 2,650 | 24.06.2019 | 05.08.2019 | (853) | (854) | (0,05) |
| | 2,660 | 11.06.2019 | 10.07.2019 | (8.462) | (8.475) | (0,52) |
| **Summe Rückkaufgeschäfte** | | | | | **$ (17.076)** | **(1,05)** |

(1) In dem für Rückkaufgeschäfte zahlbaren Betrag sind USD 10 für einen aufgeschobenen Kursrückgang enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 551 | $ (530) | $ 21 |
| BPS | 14 | 0 | 14 |
| BRC | 2.200 | (2.010) | 190 |
| CBK | 1.072 | (690) | 382 |
| DUB | 161 | (200) | (39) |
| FAR | (234) | 260 | 26 |
| FBF | 26 | 0 | 26 |
| GLM | 2.909 | (2.830) | 79 |
| GSC | (36) | 0 | (36) |
| GST | 76 | 0 | 76 |
| HUS | 42 | 0 | 42 |
| JPM | (258) | 152 | (106) |
| JPS | (116) | 410 | 294 |
| MSB | 80 | 0 | 80 |
| MYC | 397 | (966) | (569) |
| MYI | 2.235 | (2.110) | 125 |
| SAL | 308 | (250) | 58 |
| SCX | (343) | 600 | 257 |
| SSB | 790 | (560) | 230 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 49,54 | 23,08 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 140,67 | 143,38 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,07 | 0,19 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (1,81) | (0,74) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,37) | 0,32 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,60 | (0,36) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (6,70) | (49,42) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (45,13) | (24,73) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (1,05) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 1,87 | 3,18 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,13 | 0,10 |
| US-Regierungsbehörden | 86,14 | 89,45 |
| US-Schatzobligationen | 27,58 | 10,44 |
| Non-Agency-MBS | 21,02 | 20,67 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 49,56 | 42,39 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,07 | 0,04 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 3,91 | 0,38 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (1,81) | (0,74) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Zinsswaps | (0,37) | 0,32 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoption | 0,04 | 0,02 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Zinsswapoption | (0,05) | (0,04) |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,04) | (0,27) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,06 | (0,16) |
| Zinsswaps | (0,01) | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | (0,06) | 0,02 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,66 | 0,07 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (6,70) | (49,42) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (82,00) | (16,45) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **BRASILIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telefonica Brasil S.A. ADR | 8.299 | $ 108 | 0,09 |
| TIM Participacoes S.A. ADR | 2.276 | 34 | 0,03 |
| | | 142 | 0,12 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Cyrela Brazil Realty S.A. Empreendimentos e Participacoes | 4.700 | 25 | 0,02 |
| Guararapes Confeccoes S.A. | 5.100 | 22 | 0,02 |
| Kroton Educacional S.A. | 17.300 | 50 | 0,04 |
| MRV Engenharia e Participacoes S.A. | 4.700 | 24 | 0,02 |
| Petrobras Distribuidora S.A. | 6.100 | 40 | 0,04 |
| Via Varejo S.A. (a) | 47.200 | 62 | 0,05 |
| | | 223 | 0,19 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Ambev S.A. | 4.600 | 22 | 0,02 |
| BRF S.A. (a) | 14.700 | 113 | 0,10 |
| JBS S.A. | 115.900 | 642 | 0,54 |
| Marfrig Global Foods S.A. (a) | 49.300 | 81 | 0,07 |
| Natura Cosmeticos S.A. | 4.500 | 66 | 0,06 |
| | | 924 | 0,79 |
| **ENERGIE** | | | |
| Cosan Ltd. 'A' | 3.953 | 53 | 0,04 |
| Cosan S.A. | 1.700 | 20 | 0,02 |
| Petroleo Brasileiro S.A. SP - ADR | 59.700 | 930 | 0,79 |
| | | 1.003 | 0,85 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Banco Bradesco S.A. ADR | 75.455 | 741 | 0,63 |
| Banco BTG Pactual S.A. | 5.300 | 71 | 0,06 |
| Banco do Brasil S.A. | 59.900 | 843 | 0,72 |
| Banco Santander Brasil S.A. | 10.200 | 121 | 0,10 |
| Itau Unibanco Holding S.A. SP – DR 'H' | 81.987 | 772 | 0,65 |
| Porto Seguro S.A. | 5.800 | 78 | 0,07 |
| Sul America S.A. | 3.992 | 39 | 0,03 |
| | | 2.665 | 2,26 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| CCR S.A. | 21.800 | 78 | 0,07 |
| Embraer S.A. SP - ADR | 1.962 | 39 | 0,03 |
| | | 117 | 0,10 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Cielo S.A. | 23.900 | 42 | 0,04 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Cia Siderurgica Nacional S.A. | 3.464 | 15 | 0,01 |
| Cia Siderurgica Nacional S.A. SP - ADR | 32.214 | 139 | 0,12 |
| Duratex S.A. | 7.900 | 24 | 0,02 |
| Gerdau S.A. SP - ADR | 9.612 | 37 | 0,03 |
| Nexa Resources S.A. | 6.404 | 62 | 0,05 |
| Suzano S.A. | 1.800 | 16 | 0,02 |
| Vale S.A. | 46.842 | 633 | 0,54 |
| | | 926 | 0,79 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| AES Tiete Energia S.A. | 35.700 | 110 | 0,09 |
| Alupar Investimento S.A. | 3.400 | 23 | 0,02 |
| Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo | 4.700 | $ 58 | 0,05 |
| Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA | 1.400 | 24 | 0,02 |
| Cia de Saneamento do Parana | 2.300 | 48 | 0,04 |
| Cia Energetica de Minas Gerais SP - ADR | 122.567 | 467 | 0,40 |
| EDP - Energias do Brasil S.A. | 8.700 | 43 | 0,04 |
| Engie Brasil Energia S.A. | 3.500 | 40 | 0,03 |
| Light S.A. | 19.300 | 97 | 0,08 |
| Transmissora Alianca de Energia Eletrica S.A. | 3.100 | 22 | 0,02 |
| | | 932 | 0,79 |
| Summe Brasilien | | 6.974 | 5,93 |
| **CHILE** | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Cencosud S.A. | 107.583 | 211 | 0,18 |
| Cia Cervecerias Unidas S.A. SP - ADR | 754 | 21 | 0,02 |
| | | 232 | 0,20 |
| **ENERGIE** | | | |
| Empresas COPEC S.A. | 1.895 | 21 | 0,02 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Banco de Chile | 454.631 | 67 | 0,06 |
| Banco Santander Chile ADR | 561 | 17 | 0,01 |
| Itau CorpBanca | 1.926.886 | 16 | 0,01 |
| | | 100 | 0,08 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| AntarChile S.A. | 3.270 | 39 | 0,03 |
| Latam Airlines Group S.A. | 2.390 | 23 | 0,02 |
| | | 62 | 0,05 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| CAP S.A. | 8.024 | 92 | 0,08 |
| Empresas CMPC S.A. | 14.780 | 40 | 0,03 |
| | | 132 | 0,11 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| AES Gener S.A. | 313.552 | 86 | 0,07 |
| Colbun S.A. | 109.111 | 22 | 0,02 |
| Enel Americas S.A. | 121.800 | 21 | 0,02 |
| Inversiones Aguas Metropolitanas S.A. | 13.384 | 21 | 0,02 |
| | | 150 | 0,13 |
| Summe Chile | | 697 | 0,59 |
| **CHINA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| China Communications Services Corp. Ltd. 'H' | 238.000 | 184 | 0,16 |
| China Telecom Corp. Ltd. 'H' | 1.384.000 | 697 | 0,59 |
| Sohu.com Ltd. ADR (a) | 2.519 | 35 | 0,03 |
| | | 916 | 0,78 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| BAIC Motor Corp. Ltd. 'H' | 132.000 | 83 | 0,07 |
| Dongfeng Motor Group Co. Ltd. 'H' | 138.000 | 113 | 0,10 |
| Golden Eagle Retail Group Ltd. | 18.000 | 21 | 0,02 |
| GOME Retail Holdings Ltd. (a) | 1.110.000 | 119 | 0,10 |
| Great Wall Motor Co. Ltd. 'H' | 116.000 | 83 | 0,07 |
| Shanghai Jin Jiang International Hotels Group Co. Ltd. 'H' | 122.000 | 25 | 0,02 |
| | | 444 | 0,38 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Hengan International Group Co. Ltd. | 7.000 | $ 52 | 0,04 |
| Tingyi Cayman Islands Holding Corp. | 42.000 | 70 | 0,06 |
| Uni-President China Holdings Ltd. | 21.000 | 23 | 0,02 |
| Want Want China Holdings Ltd. | 98.000 | 80 | 0,07 |
| | | 225 | 0,19 |
| **ENERGIE** | | | |
| China Coal Energy Co. Ltd. 'H' | 129.000 | 54 | 0,05 |
| China Oilfield Services Ltd. 'H' | 40.000 | 40 | 0,03 |
| China Petroleum & Chemical Corp. 'H' | 1.560.000 | 1.063 | 0,90 |
| China Shenhua Energy Co. Ltd. 'H' | 232.000 | 486 | 0,41 |
| CNOOC Ltd. | 664.000 | 1.132 | 0,96 |
| PetroChina Co. Ltd. 'H' | 822.000 | 453 | 0,39 |
| Yanzhou Coal Mining Co. Ltd. 'H' | 24.000 | 22 | 0,02 |
| | | 3.250 | 2,76 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Agricultural Bank of China Ltd. 'H' | 2.006.000 | 840 | 0,71 |
| Bank of China Ltd. 'H' | 5.810.000 | 2.451 | 2,08 |
| Bank of Chongqing Co. Ltd. 'H' | 56.000 | 33 | 0,03 |
| Bank of Communications Co. Ltd. 'H' | 780.000 | 592 | 0,50 |
| China Cinda Asset Management Co. Ltd. 'H' | 1.181.000 | 272 | 0,23 |
| China CITIC Bank Corp. Ltd. 'H' | 929.000 | 529 | 0,45 |
| China Construction Bank Corp. 'H' | 5.139.000 | 4.429 | 3,76 |
| China Everbright Bank Co. Ltd. 'H' | 379.000 | 174 | 0,15 |
| China Huarong Asset Management Co. Ltd. 'H' | 1.360.000 | 237 | 0,20 |
| China Life Insurance Co. Ltd. 'H' | 57.000 | 141 | 0,12 |
| China Merchants Bank Co. Ltd. 'H' | 100.000 | 496 | 0,42 |
| China Minsheng Banking Corp. Ltd. 'H' | 513.700 | 356 | 0,30 |
| China Reinsurance Group Corp. 'H' | 99.000 | 18 | 0,02 |
| Chongqing Rural Commercial Bank Co. Ltd. 'H' | 388.000 | 211 | 0,18 |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 'H' | 3.960.000 | 2.890 | 2,46 |
| People's Insurance Co. Group of China Ltd. 'H' | 263.000 | 103 | 0,09 |
| PICC Property & Casualty Co. Ltd. 'H' | 146.000 | 158 | 0,14 |
| Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H' | 56.000 | 673 | 0,57 |
| Postal Savings Bank of China Co. Ltd. 'H' | 817.000 | 485 | 0,41 |
| | | 15.088 | 12,82 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| China Resources Pharmaceutical Group Ltd. | 12.500 | 14 | 0,01 |
| Shanghai Pharmaceuticals Holding Co. Ltd. 'H' | 21.900 | 43 | 0,04 |
| Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd. | 66.000 | 15 | 0,01 |
| Sinopharm Group Co. Ltd. 'H' | 12.800 | 45 | 0,04 |
| | | 117 | 0,10 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Emerging Markets Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000$) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Air China Ltd. 'H' | 80.000 | $ 80 | 0,07 |
| AviChina Industry & Technology Co. Ltd. 'H' | 28.000 | 15 | 0,01 |
| China Communications Construction Co. Ltd. 'H' | 161.000 | 144 | 0,12 |
| China Eastern Airlines Corp. Ltd. 'H' | 94.000 | 55 | 0,05 |
| China Lesso Group Holdings Ltd. 'L' | 109.000 | 88 | 0,08 |
| China Machinery Engineering Corp. 'H' | 41.000 | 18 | 0,02 |
| China Railway Construction Corp. Ltd. 'H' | 164.000 | 201 | 0,17 |
| China Railway Group Ltd. 'H' | 246.000 | 187 | 0,16 |
| China Southern Airlines Co. Ltd. 'H' | 110.000 | 76 | 0,06 |
| COSCO SHIPPING Energy Transportation Co. Ltd. 'H' | 130.000 | 77 | 0,07 |
| Fosun International Ltd. | 45.500 | 61 | 0,05 |
| Guangshen Railway Co. Ltd. 'H' | 108.000 | 37 | 0,03 |
| Harbin Electric Co. Ltd. 'H' | 74.000 | 37 | 0,03 |
| Metallurgical Corp. of China Ltd. | 72.000 | 19 | 0,02 |
| Shenzhen Expressway Co. Ltd. 'H' | 52.000 | 62 | 0,05 |
| Sinopec Engineering Group Co. Ltd. 'H' | 81.000 | 69 | 0,06 |
| Sinotrans Ltd. 'H' | 73.000 | 27 | 0,02 |
| Sinotruk Hong Kong Ltd. | 32.000 | 55 | 0,05 |
| Weichai Power Co. Ltd. 'H' | 13.000 | 22 | 0,02 |
| Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd. | 77.300 | 88 | 0,07 |
| Zhejiang Expressway Co. Ltd. 'H' | 124.000 | 131 | 0,11 |
| Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co. Ltd. 'H' | 87.800 | 58 | 0,05 |
| | | 1.607 | 1,37 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| FIH Mobile Ltd. | 164.000 | 18 | 0,02 |
| Legend Holdings Corp. 'H' | 30.814 | 73 | 0,06 |
| Lenovo Group Ltd. | 858.000 | 664 | 0,56 |
| Semiconductor Manufacturing International Corp. (a) | 17.500 | 20 | 0,02 |
| | | 775 | 0,66 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Anhui Conch Cement Co. Ltd. 'H' | 12.000 | 75 | 0,06 |
| China BlueChemical Ltd. 'H' | 246.000 | 67 | 0,06 |
| China Hongqiao Group Ltd. | 111.500 | 79 | 0,07 |
| China National Building Material Co. Ltd. 'H' | 693.550 | 607 | 0,51 |
| China Zhongwang Holdings Ltd. | 119.600 | 60 | 0,05 |
| | | 888 | 0,75 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Agile Group Holdings Ltd. | 126.000 | 169 | 0,14 |
| Beijing Capital Land Ltd. 'H' | 188.000 | 67 | 0,06 |
| Beijing North Star Co. Ltd. | 54.000 | 20 | 0,02 |
| China Aoyuan Group Ltd. | 71.000 | 100 | 0,08 |
| China Evergrande Group | 8.000 | 22 | 0,02 |
| China SCE Property Holdings Ltd. | 45.000 | 22 | 0,02 |
| China Vanke Co. Ltd. 'H' | 9.100 | 34 | 0,03 |
| Fantasia Holdings Group Co. Ltd. | 247.500 | 45 | 0,04 |
| Future Land Development Holdings Ltd. | 48.000 | 63 | 0,05 |
| Greentown China Holdings Ltd. | 130.000 | 93 | 0,08 |
| Guangzhou R&F Properties Co. Ltd. 'H' | 120.000 | $ 231 | 0,20 |
| Guorui Properties Ltd. | 92.000 | 18 | 0,02 |
| KWG Property Holding Ltd. | 58.000 | 59 | 0,05 |
| Longfor Group Holdings Ltd. | 14.000 | 53 | 0,04 |
| Powerlong Real Estate Holdings Ltd. | 149.577 | 75 | 0,06 |
| Shui On Land Ltd. | 463.000 | 107 | 0,09 |
| Sino-Ocean Group Holding Ltd. | 440.000 | 187 | 0,16 |
| SOHO China Ltd. | 259.500 | 92 | 0,08 |
| Yuzhou Properties Co. Ltd. | 203.000 | 95 | 0,08 |
| | | 1.552 | 1,32 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| China Datang Corp. Renewable Power Co. Ltd. 'H' | 158.000 | 17 | 0,02 |
| China Longyuan Power Group Corp. Ltd. 'H' | 242.000 | 155 | 0,13 |
| Datang International Power Generation Co. Ltd. 'H' | 394.000 | 99 | 0,08 |
| Huadian Fuxin Energy Corp. Ltd. 'H' | 298.000 | 55 | 0,05 |
| Huadian Power International Corp. Ltd. 'H' | 424.000 | 168 | 0,14 |
| Huaneng Power International, Inc. 'H' | 522.000 | 307 | 0,26 |
| Huaneng Renewables Corp. Ltd. 'H' | 124.000 | 34 | 0,03 |
| | | 835 | 0,71 |
| Summe China | | 25.697 | 21,84 |
| **GRIECHENLAND** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Hellenic Telecommunications Organization S.A. | 12.429 | 184 | 0,16 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| FF Group (a) | 1.196 | 0 | 0,00 |
| OPAP S.A. | 5.491 | 62 | 0,05 |
| | | 62 | 0,05 |
| **ENERGIE** | | | |
| Motor Oil Hellas Corinth Refineries S.A. | 2.545 | 65 | 0,06 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Alpha Bank AE (a) | 192.824 | 387 | 0,33 |
| Eurobank Ergasias S.A. (a) | 9.951 | 10 | 0,01 |
| National Bank of Greece S.A. (a) | 124.801 | 342 | 0,29 |
| Piraeus Bank S.A. (a) | 89.446 | 312 | 0,26 |
| | | 1.051 | 0,89 |
| Summe Griechenland | | 1.362 | 1,16 |
| **HONGKONG** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| China Mobile Ltd. | 167.000 | 1.520 | 1,29 |
| China Unicom Hong Kong Ltd. | 410.000 | 448 | 0,38 |
| | | 1.968 | 1,67 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| China Agri-Industries Holdings Ltd. | 147.000 | 47 | 0,04 |
| China Foods Ltd. | 54.000 | 23 | 0,02 |
| China Resources Beer Holdings Co. Ltd. | 56.000 | 266 | 0,23 |
| | | 336 | 0,29 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| BOC Hong Kong Holdings Ltd. | 61.500 | $ 242 | 0,20 |
| China Everbright Ltd. | 102.000 | 151 | 0,13 |
| China Taiping Insurance Holdings Co. Ltd. | 91.000 | 244 | 0,21 |
| Far East Horizon Ltd. | 102.000 | 104 | 0,09 |
| Legend Holdings Corp. 'H' - Exp. 23.05.2019 | 2.370 | 0 | 0,00 |
| | | 741 | 0,63 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| China Merchants Port Holdings Co. Ltd. | 12.000 | 20 | 0,02 |
| CITIC Ltd. | 469.000 | 675 | 0,57 |
| COSCO SHIPPING Ports Ltd. | 150.000 | 148 | 0,12 |
| Shanghai Industrial Holdings Ltd. | 58.000 | 126 | 0,11 |
| Shenzhen International Holdings Ltd. | 10.000 | 20 | 0,02 |
| | | 989 | 0,84 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| China Resources Cement Holdings Ltd. | 100.000 | 97 | 0,08 |
| Shougang Fushan Resources Group Ltd. | 198.000 | 43 | 0,04 |
| | | 140 | 0,12 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| China Jinmao Holdings Group Ltd. | 212.000 | 129 | 0,11 |
| China Overseas Land & Investment Ltd. | 76.000 | 280 | 0,24 |
| China Resources Land Ltd. | 54.000 | 238 | 0,20 |
| Poly Property Group Co. Ltd. | 286.000 | 105 | 0,09 |
| Shenzhen Investment Ltd. | 338.000 | 125 | 0,11 |
| Yuexiu Property Co. Ltd. | 746.000 | 169 | 0,14 |
| | | 1.046 | 0,89 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Beijing Enterprises Holdings Ltd. | 11.500 | 58 | 0,05 |
| China Power International Development Ltd. | 847.000 | 207 | 0,17 |
| China Resources Power Holdings Co. Ltd. | 250.000 | 365 | 0,31 |
| Guangdong Investment Ltd. | 10.000 | 20 | 0,02 |
| Kunlun Energy Co. Ltd. | 172.000 | 150 | 0,13 |
| | | 800 | 0,68 |
| Summe Hongkong | | 6.020 | 5,12 |
| **INDIEN** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Tata Motors Ltd. ADR (a) | 79.161 | 925 | 0,79 |
| **ENERGIE** | | | |
| Reliance Industries Ltd. GDR | 16.040 | 580 | 0,49 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| ICICI Bank Ltd. SP - ADR | 82.456 | 1.038 | 0,88 |
| State Bank of India GDR (a) | 23.800 | 1.233 | 1,05 |
| | | 2.271 | 1,93 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Dr Reddy's Laboratories Ltd. ADR | 9.531 | 357 | 0,30 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Infosys Ltd. SP - ADR | 42.512 | 455 | 0,39 |
| Wipro Ltd. ADR | 39.236 | 170 | 0,14 |
| | | 625 | 0,53 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Tata Steel Ltd. GDR | 58.572 | $ 421 | 0,36 |
| Vedanta Ltd. ADR | 83.760 | 852 | 0,72 |
| | | 1.273 | 1,08 |
| Summe Indien | | 6.031 | 5,12 |
| **INDONESIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Indosat Tbk PT | 457.000 | 85 | 0,07 |
| Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT | 606.500 | 178 | 0,15 |
| XL Axiata Tbk PT | 99.400 | 21 | 0,02 |
| | | 284 | 0,24 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Astra International Tbk PT | 78.300 | 41 | 0,04 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Indofood Sukses Makmur Tbk PT | 284.000 | 141 | 0,12 |
| **ENERGIE** | | | |
| Adaro Energy Tbk PT | 1.203.400 | 116 | 0,10 |
| Bukit Asam Tbk PT | 157.200 | 33 | 0,03 |
| Indo Tambangraya Megah Tbk PT | 92.100 | 115 | 0,09 |
| | | 264 | 0,22 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bank CIMB Niaga Tbk PT | 267.500 | 21 | 0,02 |
| Bank Danamon Indonesia Tbk PT | 210.000 | 71 | 0,06 |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT | 133.700 | 76 | 0,06 |
| Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT | 146.700 | 96 | 0,08 |
| Bank Pan Indonesia Tbk PT | 230.500 | 21 | 0,02 |
| Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | 420.400 | 130 | 0,11 |
| | | 415 | 0,35 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Indah Kiat Pulp & Paper Corp. Tbk PT | 95.300 | 64 | 0,05 |
| Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT | 64.500 | 91 | 0,08 |
| Semen Indonesia Persero Tbk PT | 84.200 | 69 | 0,06 |
| | | 224 | 0,19 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Perusahaan Gas Negara Tbk PT | 1.168.000 | 174 | 0,15 |
| Summe Indonesien | | 1.543 | 1,31 |
| **MALAYSIA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Axiata Group Bhd. | 24.000 | 29 | 0,02 |
| Telekom Malaysia Bhd. | 155.600 | 151 | 0,13 |
| | | 180 | 0,15 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| DRB-Hicom Bhd. | 37.000 | 20 | 0,02 |
| Genting Bhd. | 75.000 | 123 | 0,10 |
| Genting Malaysia Bhd. | 25.900 | 20 | 0,02 |
| UMW Holdings Bhd. | 27.300 | 36 | 0,03 |
| | | 199 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| British American Tobacco Malaysia Bhd. | 10.600 | 74 | 0,06 |
| Felda Global Ventures Holdings Bhd. (a) | 323.200 | $ 87 | 0,08 |
| | | 161 | 0,14 |
| **ENERGIE** | | | |
| Sapura Energy Bhd. | 2.176.700 | 159 | 0,13 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| AMMB Holdings Bhd. | 100.000 | 102 | 0,09 |
| CIMB Group Holdings Bhd. | 97.000 | 126 | 0,11 |
| Hong Leong Financial Group Bhd. | 15.000 | 67 | 0,06 |
| Malayan Banking Bhd. | 129.200 | 278 | 0,23 |
| Public Bank Bhd. | 19.500 | 109 | 0,09 |
| RHB Bank Bhd. | 63.100 | 86 | 0,07 |
| | | 768 | 0,65 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Berjaya Corp. Bhd. (a) | 500.200 | 31 | 0,03 |
| IJM Corp. Bhd. | 171.900 | 100 | 0,08 |
| MISC Bhd. | 39.100 | 68 | 0,06 |
| MMC Corp. Bhd. | 123.700 | 34 | 0,03 |
| Sime Darby Bhd. | 128.700 | 70 | 0,06 |
| | | 303 | 0,26 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Astro Malaysia Holdings Bhd. | 194.100 | 68 | 0,06 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Petronas Chemicals Group Bhd. | 9.400 | 19 | 0,02 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Tenaga Nasional Bhd. | 33.100 | 111 | 0,09 |
| YTL Corp. Bhd. | 305.250 | 83 | 0,07 |
| YTL Power International Bhd. | 273.692 | 54 | 0,05 |
| | | 248 | 0,21 |
| Summe Malaysia | | 2.105 | 1,79 |
| **MALTA** | | | |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Brait SE | 17.590 | 23 | 0,02 |
| **MEXIKO** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| America Movil S.A.B. de C.V. SP - ADR 'L' | 29.069 | 423 | 0,36 |
| Grupo Televisa S.A.B. ADR | 6.790 | 58 | 0,05 |
| | | 481 | 0,41 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Nemak S.A.B. de C.V. | 148.200 | 69 | 0,06 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Coca-Cola Femsa S.A.B. de C.V. SP - ADR | 501 | 31 | 0,03 |
| Fomento Economico Mexicano S.A.B. de C.V. SP - ADR | 1.746 | 169 | 0,14 |
| Grupo Bimbo S.A.B. de C.V. 'A' | 49.300 | 103 | 0,09 |
| Grupo Comercial Chedraui S.A. de C.V. | 10.900 | 18 | 0,02 |
| Kimberly-Clark de Mexico S.A.B. de C.V. 'A' | 31.000 | 57 | 0,05 |
| Wal-Mart de Mexico S.A.B. de C.V. | 62.600 | 171 | 0,14 |
| | | 549 | 0,47 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **FINANZWERTE** | | | |
| Banco Santander Mexico S.A. | 27.000 | $ 41 | 0,03 |
| Gentera S.A.B. de C.V. | 189.000 | 163 | 0,14 |
| Grupo Elektra S.A.B. de C.V. | 320 | 21 | 0,02 |
| Grupo Financiero Banorte S.A.B. de C.V. 'O' | 36.100 | 209 | 0,18 |
| Grupo Financiero Inbursa S.A.B. de C.V. 'O' | 54.200 | 79 | 0,07 |
| | | 513 | 0,44 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Alfa S.A.B. de C.V. 'A' | 292.900 | 288 | 0,24 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Alpek S.A.B. de C.V. | 17.400 | 22 | 0,02 |
| Cemex S.A.B. de C.V. SP - ADR | 132.110 | 560 | 0,47 |
| Grupo Mexico S.A.B. de C.V. 'B' | 47.500 | 126 | 0,11 |
| Industrias Penoles S.A.B. de C.V. | 4.200 | 54 | 0,04 |
| Mexichem S.A.B. de C.V. | 9.200 | 20 | 0,02 |
| | | 782 | 0,66 |
| Summe Mexiko | | 2.682 | 2,28 |
| **PHILIPPINEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Globe Telecom, Inc. | 2.105 | 93 | 0,08 |
| PLDT, Inc. | 8.885 | 223 | 0,19 |
| | | 316 | 0,27 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Metropolitan Bank & Trust Co. | 32.961 | 46 | 0,04 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Alliance Global Group, Inc. | 307.400 | 93 | 0,08 |
| DMCI Holdings, Inc. | 319.700 | 64 | 0,05 |
| International Container Terminal Services, Inc. | 7.820 | 22 | 0,02 |
| San Miguel Corp. | 16.650 | 57 | 0,05 |
| | | 236 | 0,20 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| First Gen Corp. | 48.500 | 25 | 0,02 |
| Manila Electric Co. | 7.920 | 60 | 0,05 |
| | | 85 | 0,07 |
| Summe Philippinen | | 683 | 0,58 |
| **POLEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Orange Polska S.A. (a) | 86.441 | 155 | 0,13 |
| PLAY Communications S.A. | 18.430 | 160 | 0,14 |
| | | 315 | 0,27 |
| **ENERGIE** | | | |
| Polski Koncern Naftowy ORLEN S.A. | 3.029 | 73 | 0,06 |
| Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo S.A. | 70.949 | 101 | 0,09 |
| | | 174 | 0,15 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Alior Bank S.A. (a) | 1.510 | 20 | 0,02 |
| Bank Polska Kasa Opieki S.A. | 11.152 | 335 | 0,28 |
| Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A. | 7.645 | 88 | 0,07 |
| Powszechny Zaklad Ubezpieczen S.A. | 11.646 | 136 | 0,12 |
| | | 579 | 0,49 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Grupa Azoty S.A. | 5.267 | 60 | 0,05 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Emerging Markets Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| KGHM Polska Miedz S.A. | 2.986 | $ 83 | 0,07 |
| | | 143 | 0,12 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Enea S.A. | 41.745 | 104 | 0,09 |
| Energa S.A. | 38.057 | 80 | 0,07 |
| PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. (a) | 60.094 | 155 | 0,13 |
| Tauron Polska Energia S.A. | 196.069 | 90 | 0,07 |
| | | 429 | 0,36 |
| Summe Polen | | 1.640 | 1,39 |
| **RUSSLAND** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Mobile TeleSystems PJSC | 125.300 | 565 | 0,48 |
| Rostelecom PJSC | 116.880 | 150 | 0,13 |
| Sistema PJSC FC | 99.404 | 16 | 0,01 |
| Sistema PJSC FC SP - GDR | 41.521 | 128 | 0,11 |
| | | 859 | 0,73 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Lenta Ltd. (a) | 8.343 | 27 | 0,02 |
| Magnit PJSC | 5.936 | 352 | 0,30 |
| X5 Retail Group NV GDR | 5.097 | 175 | 0,15 |
| | | 554 | 0,47 |
| **ENERGIE** | | | |
| Gazprom Neft PJSC SP - ADR | 3.761 | 117 | 0,10 |
| Gazprom PJSC SP - ADR | 888.645 | 6.511 | 5,53 |
| Lukoil PJSC SP - ADR | 24.140 | 2.031 | 1,73 |
| Rosneft Oil, Co. PJSC GDR | 72.158 | 473 | 0,40 |
| Surgutneftegas OJSC SP - ADR | 177.500 | 730 | 0,62 |
| Tatneft PJSC SP - ADR | 1.307 | 97 | 0,08 |
| TMK PJSC | 22.250 | 21 | 0,02 |
| | | 9.980 | 8,48 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Sberbank of Russia PJSC SP - ADR | 33.410 | 511 | 0,43 |
| VTB Bank PJSC | 65.910.000 | 42 | 0,04 |
| VTB Bank PJSC GDR | 24.070 | 30 | 0,03 |
| | | 583 | 0,50 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Aeroflot PJSC | 115.500 | 186 | 0,16 |
| Globaltrans Investment PLC GDR | 7.960 | 74 | 0,06 |
| | | 260 | 0,22 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Alrosa PJSC | 75.700 | 103 | 0,09 |
| Evraz PLC | 9.506 | 81 | 0,07 |
| Mechel PJSC (a) | 13.600 | 14 | 0,01 |
| Mechel PJSC SP - ADR | 42.847 | 89 | 0,07 |
| MMC Norilsk Nickel PJSC ADR | 14.512 | 327 | 0,28 |
| PhosAgro PJSC GDR | 6.146 | 81 | 0,07 |
| Polyus PJSC GDR | 1.216 | 56 | 0,05 |
| Severstal PJSC GDR | 11.390 | 192 | 0,16 |
| | | 943 | 0,80 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| LSR Group PJSC | 1.910 | 24 | 0,02 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Federal Grid Co. Unified Energy System PJSC | 25.590.000 | 82 | 0,07 |
| Inter RAO UES PJSC | 870.000 | 63 | 0,06 |
| Rosseti PJSC | 7.158.007 | $ 157 | 0,13 |
| RusHydro PJSC | 11.268.000 | 107 | 0,09 |
| Unipro PJSC | 1.065.000 | 44 | 0,04 |
| | | 453 | 0,39 |
| Summe Russland | | 13.656 | 11,61 |
| **SINGAPUR** | | | |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| BOC Aviation Ltd. | 14.000 | 117 | 0,10 |
| **SÜDAFRIKA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| MTN Group Ltd. | 127.625 | 964 | 0,82 |
| Telkom S.A. SOC Ltd. | 48.862 | 319 | 0,27 |
| Vodacom Group Ltd. | 2.531 | 22 | 0,02 |
| | | 1.305 | 1,11 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Motus Holdings Ltd. | 6.555 | 34 | 0,03 |
| Truworths International Ltd. | 4.247 | 21 | 0,02 |
| Tsogo Sun Holdings Ltd. | 14.465 | 16 | 0,01 |
| Tsogo Sun Hotels Ltd. (a) | 14.465 | 4 | 0,00 |
| Woolworths Holdings Ltd. | 25.648 | 89 | 0,08 |
| | | 164 | 0,14 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Massmart Holdings Ltd. | 10.011 | 44 | 0,03 |
| Tiger Brands Ltd. | 1.398 | 22 | 0,02 |
| | | 66 | 0,05 |
| **ENERGIE** | | | |
| Exxaro Resources Ltd. | 1.750 | 21 | 0,02 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Absa Group Ltd. | 50.057 | 625 | 0,53 |
| FirstRand Ltd. | 55.760 | 271 | 0,23 |
| Investec Ltd. | 21.160 | 138 | 0,12 |
| Liberty Holdings Ltd. | 14.815 | 111 | 0,09 |
| MMI Holdings Ltd. | 110.820 | 149 | 0,13 |
| Nedbank Group Ltd. | 14.201 | 255 | 0,22 |
| Sanlam Ltd. | 4.032 | 23 | 0,02 |
| Standard Bank Group Ltd. | 29.674 | 414 | 0,35 |
| | | 1.986 | 1,69 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Aspen Pharmacare Holdings Ltd. | 3.200 | 23 | 0,02 |
| Life Healthcare Group Holdings Ltd. | 17.682 | 28 | 0,02 |
| Netcare Ltd. | 65.300 | 83 | 0,07 |
| | | 134 | 0,11 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Barloworld Ltd. | 17.842 | 162 | 0,14 |
| Imperial Logistics Ltd. | 11.672 | 42 | 0,03 |
| | | 204 | 0,17 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| AngloGold Ashanti Ltd. SP - ADR | 8.575 | 153 | 0,13 |
| Gold Fields Ltd. SP - ADR | 80.000 | 433 | 0,37 |
| Impala Platinum Holdings Ltd. (a) | 61.029 | 302 | 0,26 |
| Kumba Iron Ore Ltd. | 4.357 | 154 | 0,13 |
| Nampak Ltd. (a) | 58.135 | 42 | 0,03 |
| Sappi Ltd. | 5.238 | 20 | 0,02 |
| Sasol Ltd. | 28.288 | 703 | 0,60 |
| Sibanye Gold Ltd. (a) | 41.513 | $ 49 | 0,04 |
| | | 1.856 | 1,58 |
| Summe Südafrika | | 5.736 | 4,87 |
| **SÜDKOREA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| KT Corp. SP - ADR | 61.664 | 763 | 0,65 |
| LG Uplus Corp. | 35.628 | 447 | 0,38 |
| SK Telecom Co. Ltd. SP - ADR | 26.825 | 664 | 0,56 |
| | | 1.874 | 1,59 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Hankook Tire & Technology Co. Ltd. | 4.528 | 138 | 0,12 |
| Hyundai Department Store Co. Ltd. | 1.633 | 117 | 0,10 |
| Hyundai Mobis Co. Ltd. | 1.194 | 244 | 0,21 |
| Hyundai Motor Co. | 11.821 | 1.435 | 1,22 |
| Hyundai Wia Corp. | 3.827 | 161 | 0,14 |
| Kia Motors Corp. | 26.868 | 1.025 | 0,87 |
| Kumho Tire Co., Inc. (a) | 15.050 | 52 | 0,04 |
| LG Electronics, Inc. | 8.978 | 618 | 0,52 |
| LOTTE Himart Co. Ltd. | 1.588 | 60 | 0,05 |
| Lotte Shopping Co. Ltd. | 2.623 | 365 | 0,31 |
| Mando Corp. | 1.649 | 42 | 0,03 |
| Shinsegae, Inc. | 438 | 114 | 0,10 |
| | | 4.371 | 3,71 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Amorepacific Corp. | 340 | 18 | 0,02 |
| CJ CheilJedang Corp. | 317 | 82 | 0,07 |
| E-MART, Inc. | 1.217 | 147 | 0,12 |
| GS Retail Co. Ltd. | 1.756 | 60 | 0,05 |
| Harim Holdings Co. Ltd. | 6.073 | 60 | 0,05 |
| Hite Jinro Co. Ltd. | 7.700 | 136 | 0,12 |
| KT&G Corp. | 1.759 | 150 | 0,13 |
| | | 653 | 0,56 |
| **ENERGIE** | | | |
| GS Holdings Corp. | 5.608 | 249 | 0,21 |
| SK Innovation Co. Ltd. | 811 | 112 | 0,10 |
| | | 361 | 0,31 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| BNK Financial Group, Inc. | 40.702 | 264 | 0,23 |
| DB Insurance Co. Ltd. | 2.329 | 120 | 0,10 |
| DGB Financial Group, Inc. | 29.250 | 207 | 0,18 |
| Hana Financial Group, Inc. | 17.428 | 565 | 0,48 |
| Hanwha Life Insurance Co. Ltd. | 53.859 | 153 | 0,13 |
| Hyundai Marine & Fire Insurance Co. Ltd. | 5.013 | 123 | 0,11 |
| Industrial Bank of Korea | 31.279 | 381 | 0,32 |
| ING Life Insurance Korea Ltd. | 3.846 | 105 | 0,09 |
| JB Financial Group Co. Ltd. | 10.760 | 55 | 0,05 |
| KB Financial Group, Inc. | 9.582 | 380 | 0,32 |
| Meritz Fire & Marine Insurance Co. Ltd. | 2.810 | 50 | 0,04 |
| Mirae Asset Life Insurance Co. Ltd. | 14.949 | 57 | 0,05 |
| Samsung Card Co. Ltd. | 4.737 | 157 | 0,13 |
| Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. | 975 | 226 | 0,19 |
| Samsung Life Insurance Co. Ltd. | 6.710 | 486 | 0,41 |
| Shinhan Financial Group Co. Ltd. | 27.171 | 1.057 | 0,90 |
| Woori Financial Group, Inc. | 33.769 | 411 | 0,35 |
| | | 4.797 | 4,08 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Asiana Airlines, Inc. (a) | 39.100 | 186 | 0,16 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| CJ Corp. | 2.611 | $ 229 | 0,19 |
| Daelim Industrial Co. Ltd. | 567 | 56 | 0,05 |
| Daewoo Engineering & Construction Co. Ltd. (a) | 4.490 | 19 | 0,02 |
| Doosan Bobcat, Inc. (a) | 755 | 24 | 0,02 |
| Doosan Corp. | 2.374 | 207 | 0,18 |
| Doosan Heavy Industries & Construction Co. Ltd. | 31.834 | 171 | 0,15 |
| Doosan Infracore Co. Ltd. (a) | 26.448 | 143 | 0,12 |
| Hyundai Engineering & Construction Co. Ltd. | 3.650 | 170 | 0,14 |
| KCC Corp. | 313 | 75 | 0,06 |
| Korean Air Lines Co. Ltd. | 13.947 | 350 | 0,30 |
| LS Corp. | 3.174 | 131 | 0,11 |
| Posco International Corp. | 2.607 | 41 | 0,04 |
| SK Holdings Co. Ltd. | 204 | 41 | 0,03 |
| SK Networks Co. Ltd. | 38.427 | 169 | 0,14 |
| | | 2.012 | 1,71 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| LG Display Co. Ltd. | 35.524 | 551 | 0,47 |
| LG Innotek Co. Ltd. | 202 | 19 | 0,01 |
| Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd. | 98 | 8 | 0,01 |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 84.671 | 3.448 | 2,93 |
| SK Hynix, Inc. | 2.577 | 155 | 0,13 |
| | | 4.181 | 3,55 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Hanwha Chemical Corp. | 6.690 | 132 | 0,11 |
| Hyundai Steel Co. | 8.134 | 295 | 0,25 |
| Kolon Industries, Inc. | 3.245 | 120 | 0,10 |
| LG Chem Ltd. | 56 | 17 | 0,01 |
| Lotte Chemical Corp. | 94 | 21 | 0,02 |
| POSCO | 2.283 | 485 | 0,41 |
| Taekwang Industrial Co. Ltd. | 57 | 65 | 0,06 |
| | | 1.135 | 0,96 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Korea Electric Power Corp. | 45.941 | 1.017 | 0,87 |
| Korea Gas Corp. | 3.976 | 145 | 0,12 |
| | | 1.162 | 0,99 |
| Summe Südkorea | | 20.546 | 17,46 |
| **TAIWAN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Chunghwa Telecom Co. Ltd. | 45.000 | 164 | 0,14 |
| Far EasTone Telecommunications Co. Ltd. | 32.000 | 80 | 0,07 |
| | | 244 | 0,21 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Cheng Shin Rubber Industry Co. Ltd. | 73.000 | 94 | 0,08 |
| Formosa Taffeta Co. Ltd. | 20.000 | 25 | 0,02 |
| Pou Chen Corp. | 211.000 | 262 | 0,22 |
| Ruentex Industries Ltd. | 51.600 | 126 | 0,11 |
| Yulon Motor Co. Ltd. | 96.000 | 71 | 0,06 |
| | | 578 | 0,49 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| President Chain Store Corp. | 2.000 | 19 | 0,02 |
| Uni-President Enterprises Corp. | 101.320 | 270 | 0,23 |
| | | 289 | 0,25 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Cathay Financial Holding Co. Ltd. | 214.000 | 296 | 0,25 |
| Chang Hwa Commercial Bank Ltd. | 76.720 | $ 52 | 0,04 |
| China Development Financial Holding Corp. | 445.000 | 136 | 0,12 |
| China Life Insurance Co. Ltd. | 307.250 | 246 | 0,21 |
| CTBC Financial Holding Co. Ltd. | 246.000 | 169 | 0,14 |
| E.Sun Financial Holding Co. Ltd. | 76.837 | 64 | 0,05 |
| First Financial Holding Co. Ltd. | 195.897 | 144 | 0,12 |
| Fubon Financial Holding Co. Ltd. | 215.000 | 318 | 0,27 |
| Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd. 'C' | 141.360 | 95 | 0,08 |
| Mega Financial Holding Co. Ltd. | 314.380 | 313 | 0,27 |
| Mercuries Life Insurance Co. Ltd. (a) | 166.739 | 57 | 0,05 |
| Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd. | 132.000 | 239 | 0,20 |
| Shin Kong Financial Holding Co. Ltd. | 1.808.082 | 549 | 0,47 |
| SinoPac Financial Holdings Co. Ltd. | 606.418 | 255 | 0,22 |
| Taishin Financial Holding Co. Ltd. | 305.554 | 141 | 0,12 |
| Taiwan Business Bank | 172.088 | 76 | 0,06 |
| Taiwan Cooperative Financial Holding Co. Ltd. | 153.677 | 103 | 0,09 |
| Yuanta Financial Holding Co. Ltd. | 546.000 | 328 | 0,28 |
| | | 3.581 | 3,04 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| China Airlines Ltd. | 186.000 | 59 | 0,05 |
| Eva Airways Corp. | 109.643 | 53 | 0,05 |
| Far Eastern New Century Corp. | 284.300 | 307 | 0,26 |
| Teco Electric and Machinery Co. Ltd. | 50.000 | 37 | 0,03 |
| | | 456 | 0,39 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Asustek Computer, Inc. | 56.000 | 402 | 0,34 |
| AU Optronics Corp. | 1.407.000 | 422 | 0,36 |
| Chicony Electronics Co. Ltd. | 20.085 | 50 | 0,04 |
| Compal Electronics, Inc. | 333.000 | 218 | 0,18 |
| Delta Electronics, Inc. | 29.000 | 147 | 0,12 |
| Foxconn Technology Co. Ltd. | 41.000 | 83 | 0,07 |
| Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. | 322.364 | 804 | 0,68 |
| HTC Corp. (a) | 23.000 | 27 | 0,02 |
| Innolux Corp. | 1.478.000 | 350 | 0,30 |
| Inventec Corp. | 220.000 | 175 | 0,15 |
| Lite-On Technology Corp. | 192.190 | 282 | 0,24 |
| MediaTek, Inc. | 24.000 | 243 | 0,21 |
| Novatek Microelectronics Corp. | 30.000 | 167 | 0,14 |
| Pegatron Corp. | 217.000 | 376 | 0,32 |
| Powertech Technology, Inc. | 37.000 | 91 | 0,08 |
| Quanta Computer, Inc. | 134.000 | 261 | 0,22 |
| Synnex Technology International Corp. | 52.150 | 66 | 0,06 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. SP - ADR | 18.819 | 737 | 0,63 |
| United Microelectronics Corp. | 1.008.000 | 454 | 0,39 |
| Wistron Corp. | 339.656 | 265 | 0,22 |
| WPG Holdings Ltd. | 113.800 | 148 | 0,13 |
| Zhen Ding Technology Holding Ltd. | 45.000 | 144 | 0,12 |
| | | 5.912 | 5,02 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Asia Cement Corp. | 127.000 | $ 195 | 0,17 |
| China Steel Corp. | 148.000 | 119 | 0,10 |
| Formosa Chemicals & Fibre Corp. | 18.000 | 60 | 0,05 |
| Nan Ya Plastics Corp. | 18.000 | 45 | 0,04 |
| Taiwan Cement Corp. | 114.300 | 169 | 0,14 |
| | | 588 | 0,50 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Highwealth Construction Corp. | 73.000 | 116 | 0,10 |
| Summe Taiwan | | 11.764 | 10,00 |
| **THAILAND** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Advanced Info Service PCL | 12.200 | 87 | 0,07 |
| Total Access Communication PCL | 78.900 | 136 | 0,12 |
| | | 223 | 0,19 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Charoen Pokphand Foods PCL | 96.500 | 89 | 0,08 |
| **ENERGIE** | | | |
| Bangchak Corp. PCL | 21.500 | 21 | 0,02 |
| Banpu PCL | 239.000 | 117 | 0,10 |
| PTT Exploration & Production PCL | 85.800 | 379 | 0,32 |
| PTT PCL | 216.100 | 344 | 0,29 |
| | | 861 | 0,73 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bangkok Bank PCL | 58.200 | 374 | 0,32 |
| Kasikornbank PCL | 40.800 | 250 | 0,21 |
| Kiatnakin Bank PCL | 27.800 | 63 | 0,05 |
| Krung Thai Bank PCL | 449.800 | 286 | 0,24 |
| Siam Commercial Bank PCL | 92.600 | 422 | 0,36 |
| Thanachart Capital PCL | 127.700 | 231 | 0,20 |
| Tisco Financial Group PCL | 14.200 | 43 | 0,04 |
| TMB Bank PCL | 802.900 | 52 | 0,04 |
| | | 1.721 | 1,46 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Thai Airways International PCL (a) | 221.500 | 77 | 0,06 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| PTT Global Chemical PCL | 54.700 | 114 | 0,10 |
| Siam Cement PCL | 5.500 | 85 | 0,07 |
| | | 199 | 0,17 |
| Summe Thailand | | 3.170 | 2,69 |
| **TÜRKEI** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Turk Telekomunikasyon A/S (a) | 214.597 | 185 | 0,16 |
| Turkcell Iletisim Hizmetleri A/S | 55.864 | 123 | 0,10 |
| | | 308 | 0,26 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Arcelik A/S | 45.388 | 152 | 0,13 |
| Vestel Elektronik Sanayi ve Ticaret A/S (a) | 12.262 | 26 | 0,02 |
| | | 178 | 0,15 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii A/S | 21.330 | 73 | 0,06 |
| Coca-Cola Icecek A/S | 4.440 | 23 | 0,02 |
| Migros Ticaret A/S | 10.053 | 24 | 0,02 |
| | | 120 | 0,10 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Emerging Markets Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ENERGIE** | | | |
| Tupras Turkiye Petrol Rafinerileri A/S | 2.010 | $ 40 | 0,03 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| — | — | - | - |
| Haci Omer Sabanci Holding A/S | 397.210 | 590 | 0,50 |
| Turkiye Garanti Bankasi A/S (a) | 227.150 | 357 | 0,30 |
| Turkiye Halk Bankasi A/S | 382.650 | 379 | 0,32 |
| Turkiye Is Bankasi 'C' | 523.070 | 546 | 0,47 |
| Turkiye Vakiflar Bankasi TAO 'D' | 316.860 | 229 | 0,20 |
| Yapi ve Kredi Bankasi A/S (a) | 466.959 | 194 | 0,17 |
| | | 2.593 | 2,21 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Enka Insaat ve Sanayi A/S | 23.406 | 22 | 0,02 |
| KOC Holding A/S | 38.590 | 117 | 0,10 |
| TAV Havalimanlari Holding A/S | 15.722 | 73 | 0,06 |
| Turk Hava Yollari AO (a) | 41.960 | 93 | 0,08 |
| Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S | 38.972 | 35 | 0,03 |
| | | 340 | 0,29 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS | 32.075 | 44 | 0,04 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Enerjisa Enerji A/S | 23.226 | 22 | 0,02 |
| Summe Türkei | | 3.645 | 3,10 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Mondi Ltd. | 932 | 21 | 0,02 |
| Summe Stammaktien | | 114.112 | 96,98 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **AKTIENNAHE WERTPAPIERE** | | | |
| JPMorgan Chase Bank, N.A., Reliance Infrastructure Ltd. - Exp. 11.07.2019 | 5.030 | $ 4 | 0,00 |
| JPMorgan Chase Bank, N.A., Adani Power Ltd. - Exp. 24.02.2020 | 27.170 | 20 | 0,02 |
| JPMorgan Chase Bank, N.A., Bank of Baroda - Exp. 22.04.2021 | 20.841 | 37 | 0,03 |
| JPMorgan Chase Bank, N.A., Bharat Heavy Electricals Ltd. - Exp. 15.03.2021 | 45.290 | 48 | 0,04 |
| JPMorgan Chase Bank, N.A., Hindalco Industries Ltd. - Exp. 24.06.2021 | 6.790 | 20 | 0,02 |
| JPMorgan Chase Bank, N.A., Oriental Bank of Commerce - Exp. 11.07.2019 | 56.947 | 78 | 0,07 |
| JPMorgan Chase Bank, N.A., Power Finance Corp. Ltd. - Exp. 17.07.2019 | 37.485 | 73 | 0,06 |
| JPMorgan Chase Bank, N.A., Punjab National Bank - Exp. 23.04.2021 | 7.945 | 9 | 0,01 |
| JPMorgan Chase Bank, N.A., Steel Authority of India Ltd. - Exp. 28.04.2021 | 116.243 | 85 | 0,07 |
| JPMorgan Chase Bank, N.A., Tata Steel Ltd. - Exp. 10.12.2020 | 49.199 | 360 | 0,30 |
| | | 734 | 0,62 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Banco do Estado do Rio Grande do Sul S.A. | 40.400 | 250 | 0,21 |
| Bashneft PJSC | 2.691 | 70 | 0,06 |
| Braskem S.A. | 4.133 | 38 | 0,03 |
| Centrais Eletricas Brasileiras S.A. | 17.800 | 167 | 0,14 |
| Cia Brasileira de Distribuicao | 3.900 | 96 | 0,08 |
| Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista | 9.900 | 64 | 0,06 |
| Cia Energetica de Minas Gerais | 13.204 | 51 | 0,04 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Cia Energetica de Sao Paulo | 28.800 | $ 204 | 0,17 |
| Cia Paranaense de Energia | 21.500 | 273 | 0,23 |
| CJ Corp. | 377 | 16 | 0,02 |
| Metalurgica Gerdau S.A. | 202.100 | 382 | 0,33 |
| Transneft PJSC | 68 | 179 | 0,15 |
| | | 1.790 | 1,52 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | |
| Emlak Konut Gayrimenkul Yatirim Ortakligi A/S | 732.210 | 143 | 0,12 |
| Fibra Uno Administracion S.A. de C.V. | 30.300 | 40 | 0,03 |
| Growthpoint Properties Ltd. | 10.269 | 17 | 0,02 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | 200 | 0,17 |
| **RECHTE** | | | |
| Enel Americas S.A. - Exp. 26.07.2019 | 39.707 | 1 | 0,00 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 116.837** | **99,29** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 116.837** | **99,29** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 830** | **0,71** |
| **Nettovermögen** | | **$ 117.667** | **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.**

**Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 31.019 | $ 85.818 | $ 0 | $ 116.837 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 16.008 | $ 77.758 | $ 0 | $ 93.766 |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 ( %) | 31. Dez. 2018 ( %) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 98,66 | 97,61 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,63 | 1,36 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Stammaktien | | |
| Brasilien | 5,93 | 4,45 |
| Chile | 0,59 | 0,53 |
| China | 21,84 | 24,21 |
| Griechenland | 1,16 | 0,71 |
| Hongkong | 5,12 | 6,06 |
| Indien | 5,12 | 3,65 |
| Indonesien | 1,31 | 1,19 |
| Malaysia | 1,79 | 1,94 |
| Malta | 0,02 | 0,02 |
| Mexiko | 2,28 | 1,95 |
| Philippinen | 0,58 | 0,50 |
| Polen | 1,39 | 1,38 |
| Russland | 11,61 | 9,80 |
| Singapur | 0,10 | 0,09 |
| Südafrika | 4,87 | 4,42 |
| Südkorea | 17,46 | 19,84 |
| Taiwan | 10,00 | 10,02 |
| Thailand | 2,69 | 2,96 |
| Türkei | 3,10 | 2,59 |
| Großbritannien | 0,02 | 0,00 |
| Aktiennahe Wertpapiere | 0,62 | 1,36 |
| Vorzugswertpapiere | 1,52 | 1,24 |
| Real Estate Investment Trusts | 0,17 | 0,06 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,71 | 1,03 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Europe Fund

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | | |
| **ÖSTERREICH** | | | | |
| **ENERGIE** | | | | |
| OMV AG | 151 | € | 6 | 0,09 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| Erste Group Bank AG | 436 | | 14 | 0,19 |
| Raiffeisen Bank International AG | 363 | | 8 | 0,10 |
| Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe | 45 | | 1 | 0,01 |
| | | | 23 | 0,30 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| ANDRITZ AG | 107 | | 4 | 0,05 |
| Oesterreichische Post AG | 77 | | 2 | 0,03 |
| | | | 6 | 0,08 |
| **BAUSTOFFE** | | | | |
| voestalpine AG | 257 | | 7 | 0,09 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| Verbund AG | 26 | | 1 | 0,02 |
| Summe Österreich | | | 43 | 0,58 |
| **BELGIEN** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| Proximus SADP | 553 | | 14 | 0,19 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| Anheuser-Busch InBev S.A. NV | 88 | | 7 | 0,10 |
| Colruyt S.A. | 71 | | 3 | 0,04 |
| | | | 10 | 0,14 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| Ageas | 529 | | 24 | 0,32 |
| KBC Group NV | 214 | | 13 | 0,17 |
| | | | 37 | 0,49 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | | |
| UCB S.A. | 91 | | 7 | 0,09 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| bpost S.A. | 776 | | 6 | 0,09 |
| **BAUSTOFFE** | | | | |
| Solvay S.A. | 118 | | 11 | 0,14 |
| Summe Belgien | | | 85 | 1,14 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| Carlsberg A/S 'B' | 101 | | 12 | 0,16 |
| **ENERGIE** | | | | |
| Drilling Co. of 1972 A/S (a) | 34 | | 2 | 0,03 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| Danske Bank A/S | 301 | | 4 | 0,06 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | | |
| Novo Nordisk A/S 'B' | 214 | | 10 | 0,13 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| AP Moller - Maersk A/S 'B' | 15 | | 16 | 0,21 |
| ISS A/S | 1.081 | | 29 | 0,39 |
| | | | 45 | 0,60 |
| Summe Dänemark | | | 73 | 0,98 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| Kesko Oyj 'B' | 96 | € | 5 | 0,06 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| Nordea Bank Abp | 3.659 | | 23 | 0,31 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Kone Oyj 'B' | 102 | | 5 | 0,07 |
| Metso Oyj | 148 | | 5 | 0,07 |
| | | | 10 | 0,14 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | | |
| Nokia Oyj | 894 | | 4 | 0,05 |
| **BAUSTOFFE** | | | | |
| Stora Enso Oyj 'R' | 747 | | 8 | 0,11 |
| UPM-Kymmene Oyj | 580 | | 13 | 0,18 |
| | | | 21 | 0,29 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| Fortum Oyj | 497 | | 10 | 0,13 |
| Summe Finnland | | | 73 | 0,98 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| Iliad S.A. | 14 | | 1 | 0,01 |
| Lagardere S.C.A. | 941 | | 22 | 0,30 |
| Orange S.A. | 5.802 | | 80 | 1,07 |
| Publicis Groupe S.A. | 213 | | 10 | 0,14 |
| Television Francaise | 95 | | 1 | 0,01 |
| Vivendi S.A. | 737 | | 18 | 0,24 |
| | | | 132 | 1,77 |
| **LUXUSGÜTER** | | | | |
| Cie Generale des Etablissements Michelin S.C.A. | 292 | | 33 | 0,44 |
| Elior Group S.A. | 285 | | 3 | 0,04 |
| Kering S.A. | 11 | | 6 | 0,08 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 69 | | 26 | 0,35 |
| Peugeot S.A. | 648 | | 14 | 0,19 |
| Renault S.A. | 441 | | 24 | 0,32 |
| | | | 106 | 1,42 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| Carrefour S.A. | 3.529 | | 60 | 0,80 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 818 | | 25 | 0,33 |
| Danone S.A. | 112 | | 8 | 0,11 |
| L'Oreal S.A. | 57 | | 14 | 0,19 |
| Pernod Ricard S.A. | 31 | | 5 | 0,07 |
| | | | 112 | 1,50 |
| **ENERGIE** | | | | |
| CGG S.A. (a) | 3.401 | | 6 | 0,08 |
| Total S.A. | 2.580 | | 127 | 1,70 |
| | | | 133 | 1,78 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| AXA S.A. | 3.143 | | 73 | 0,97 |
| BNP Paribas S.A. | 2.164 | | 90 | 1,20 |
| CNP Assurances | 307 | | 6 | 0,08 |
| Credit Agricole S.A. | 1.142 | | 12 | 0,16 |
| Eurazeo S.A. | 113 | | 7 | 0,09 |
| SCOR SE | 282 | | 11 | 0,15 |
| Societe Generale S.A. | 3.423 | | 76 | 1,02 |
| | | | 275 | 3,67 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | | |
| Sanofi | 2.021 | € | 153 | 2,05 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Air France-KLM (a) | 5.033 | | 42 | 0,56 |
| Airbus SE | 37 | | 5 | 0,07 |
| ALD S.A. | 259 | | 3 | 0,04 |
| Alstom S.A. | 240 | | 10 | 0,13 |
| Bouygues S.A. | 808 | | 26 | 0,35 |
| Cie de Saint-Gobain | 1.193 | | 41 | 0,55 |
| Eiffage S.A. | 145 | | 13 | 0,17 |
| Rexel S.A. | 1.368 | | 15 | 0,20 |
| Safran S.A. | 90 | | 12 | 0,16 |
| Schneider Electric SE | 465 | | 37 | 0,50 |
| Societe BIC S.A. | 60 | | 4 | 0,05 |
| SPIE S.A. | 355 | | 6 | 0,08 |
| Vinci S.A. | 477 | | 43 | 0,58 |
| | | | 257 | 3,44 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | | |
| Atos SE | 209 | | 15 | 0,20 |
| Capgemini SE | 86 | | 10 | 0,13 |
| | | | 25 | 0,33 |
| **BAUSTOFFE** | | | | |
| Air Liquide S.A. | 35 | | 4 | 0,05 |
| Arkema S.A. | 30 | | 3 | 0,04 |
| | | | 7 | 0,09 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| Electricite de France S.A. | 3.895 | | 43 | 0,58 |
| Engie S.A. | 6.993 | | 93 | 1,24 |
| Suez | 1.670 | | 21 | 0,28 |
| Veolia Environnement S.A. | 964 | | 21 | 0,28 |
| | | | 178 | 2,38 |
| Summe Frankreich | | | 1.378 | 18,43 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| Deutsche Telekom AG | 6.139 | | 93 | 1,25 |
| ProSiebenSat.1 Media SE | 1.088 | | 15 | 0,20 |
| Telefonica Deutschland Holding AG | 1.598 | | 4 | 0,05 |
| | | | 112 | 1,50 |
| **LUXUSGÜTER** | | | | |
| adidas AG | 20 | | 6 | 0,08 |
| Bayerische Motoren Werke AG | 867 | | 56 | 0,75 |
| Ceconomy AG | 1.873 | | 10 | 0,13 |
| Continental AG | 82 | | 11 | 0,15 |
| Daimler AG | 2.169 | | 106 | 1,42 |
| Hugo Boss AG | 139 | | 8 | 0,11 |
| TUI AG | 440 | | 4 | 0,05 |
| | | | 201 | 2,69 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| METRO AG | 2.079 | | 33 | 0,44 |
| Suedzucker AG | 466 | | 7 | 0,10 |
| | | | 40 | 0,54 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| Aareal Bank AG | 198 | | 5 | 0,07 |
| Commerzbank AG | 4.059 | | 26 | 0,35 |
| Deutsche Bank AG | 11.639 | | 79 | 1,05 |
| Deutsche Pfandbriefbank AG | 420 | | 4 | 0,05 |
| Hannover Rueck SE | 59 | | 8 | 0,11 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 337 | | 74 | 0,99 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Talanx AG | 214 | € 8 | 0,11 |
| | | 204 | 2,73 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Bayer AG | 1.136 | 69 | 0,92 |
| Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA | 89 | 6 | 0,08 |
| Merck KGaA | 48 | 5 | 0,07 |
| | | 80 | 1,07 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Brenntag AG | 82 | 3 | 0,04 |
| Deutsche Lufthansa AG | 2.050 | 31 | 0,42 |
| Deutsche Post AG | 1.498 | 43 | 0,58 |
| GEA Group AG | 148 | 4 | 0,05 |
| Hochtief AG | 35 | 4 | 0,05 |
| Rheinmetall AG | 11 | 1 | 0,01 |
| Siemens AG | 612 | 64 | 0,86 |
| | | 150 | 2,01 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| SAP SE | 162 | 20 | 0,26 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| BASF SE | 995 | 64 | 0,86 |
| Evonik Industries AG | 341 | 9 | 0,12 |
| HeidelbergCement AG | 103 | 7 | 0,09 |
| K+S AG | 556 | 9 | 0,12 |
| Salzgitter AG | 268 | 7 | 0,09 |
| | | 96 | 1,28 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Vonovia SE | 96 | 4 | 0,05 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| E.ON SE | 4.424 | 42 | 0,56 |
| Innogy SE | 307 | 13 | 0,17 |
| RWE AG | 2.797 | 61 | 0,82 |
| | | 116 | 1,55 |
| Summe Deutschland | | 1.023 | 13,68 |
| **IRLAND** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Aptiv PLC | 105 | 7 | 0,10 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bank of Ireland Group PLC | 2.230 | 10 | 0,14 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Medtronic PLC | 570 | 49 | 0,65 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| AerCap Holdings NV (a) | 281 | 13 | 0,17 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| CRH PLC | 636 | 18 | 0,24 |
| Smurfit Kappa Group PLC | 320 | 9 | 0,12 |
| | | 27 | 0,36 |
| Summe Irland | | 106 | 1,42 |
| **ITALIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Mediaset SpA (a) | 1.184 | 3 | 0,04 |
| Telecom Italia SpA | 75.176 | 36 | 0,49 |
| | | 39 | 0,53 |
| **ENERGIE** | | | |
| Eni SpA | 6.584 | 96 | 1,29 |
| Saipem SpA (a) | 1.175 | 5 | 0,07 |
| | | 101 | 1,36 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Assicurazioni Generali SpA | 2.531 | € 42 | 0,56 |
| Banca Monte dei Paschi di Siena SpA (a) | 3.447 | 4 | 0,05 |
| Banca Popolare di Sondrio SCPA | 1.154 | 2 | 0,03 |
| Banco BPM SpA (a) | 8.448 | 15 | 0,20 |
| BPER Banca | 2.616 | 9 | 0,12 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 13.298 | 25 | 0,34 |
| Poste Italiane SpA | 5.825 | 54 | 0,72 |
| UniCredit SpA | 834 | 9 | 0,12 |
| Unione di Banche Italiane SpA | 3.909 | 10 | 0,13 |
| Unipol Gruppo Finanziario SpA | 3.840 | 17 | 0,23 |
| UnipolSai Assicurazioni SpA | 1.881 | 4 | 0,05 |
| | | 191 | 2,55 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ASTM SpA | 145 | 4 | 0,05 |
| Leonardo SpA | 1.048 | 12 | 0,16 |
| Salini Impregilo SpA | 2.089 | 4 | 0,05 |
| Societa Iniziative Autostradali e Servizi SpA | 331 | 5 | 0,07 |
| | | 25 | 0,33 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| A2A SpA | 2.540 | 4 | 0,05 |
| Enel SpA | 15.998 | 98 | 1,31 |
| Hera SpA | 1.240 | 4 | 0,05 |
| Snam SpA | 1.900 | 8 | 0,11 |
| Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | 987 | 6 | 0,08 |
| | | 120 | 1,60 |
| Summe Italien | | 476 | 6,37 |
| **LUXEMBURG** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| RTL Group S.A. | 158 | 7 | 0,09 |
| SES S.A. | 850 | 12 | 0,16 |
| | | 19 | 0,25 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| ArcelorMittal | 209 | 3 | 0,04 |
| Summe Luxemburg | | 22 | 0,29 |
| **NIEDERLANDE** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Koninklijke KPN NV | 7.090 | 19 | 0,25 |
| VEON Ltd. ADR | 4.679 | 12 | 0,16 |
| | | 31 | 0,41 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Heineken Holding NV | 152 | 14 | 0,19 |
| Heineken NV | 40 | 4 | 0,06 |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV | 1.998 | 39 | 0,52 |
| | | 57 | 0,77 |
| **ENERGIE** | | | |
| Fugro NV (a) | 436 | 4 | 0,05 |
| Royal Dutch Shell PLC 'A' | 5.106 | 146 | 1,95 |
| | | 150 | 2,00 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| ABN AMRO Bank NV | 267 | 5 | 0,06 |
| Aegon NV | 3.780 | 17 | 0,23 |
| ASR Nederland NV | 220 | 8 | 0,11 |
| ING Groep NV | 2.757 | 28 | 0,37 |
| NN Group NV | 153 | 5 | 0,07 |
| | | 63 | 0,84 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Koninklijke Philips NV | 893 | 34 | 0,45 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Arcadis NV | 341 | € 6 | 0,08 |
| Boskalis Westminster | 285 | 6 | 0,08 |
| Randstad NV | 103 | 5 | 0,07 |
| Signify NV | 1.080 | 28 | 0,37 |
| Wolters Kluwer NV | 236 | 15 | 0,20 |
| | | 60 | 0,80 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Akzo Nobel NV | 162 | 13 | 0,18 |
| Koninklijke DSM NV | 55 | 6 | 0,08 |
| | | 19 | 0,26 |
| Summe Niederlande | | 414 | 5,53 |
| **NORWEGEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telenor ASA | 849 | 16 | 0,21 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Marine Harvest ASA | 471 | 9 | 0,12 |
| Orkla ASA | 493 | 4 | 0,06 |
| | | 13 | 0,18 |
| **ENERGIE** | | | |
| Equinor ASA | 2.572 | 45 | 0,60 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| DNB ASA | 531 | 9 | 0,11 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Yara International ASA | 275 | 12 | 0,16 |
| Summe Norwegen | | 95 | 1,26 |
| **PORTUGAL** | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Sonae SGPS S.A. | 874 | 1 | 0,01 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Navigator Co. S.A. | 980 | 3 | 0,05 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| EDP - Energias de Portugal S.A. | 10.333 | 35 | 0,46 |
| Summe Portugal | | 39 | 0,52 |
| **SÜDAFRIKA** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Steinhoff International Holdings NV 'H' | 62.000 | 5 | 0,07 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Investec PLC | 1.440 | 8 | 0,11 |
| Summe Südafrika | | 13 | 0,18 |
| **SPANIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telefonica S.A. | 15.515 | 112 | 1,50 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Gestamp Automocion S.A. | 804 | 4 | 0,06 |
| **ENERGIE** | | | |
| Acciona S.A. | 131 | 12 | 0,16 |
| Repsol S.A. | 2.001 | 28 | 0,37 |
| | | 40 | 0,53 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | 7.702 | 38 | 0,51 |
| Banco de Sabadell S.A. | 13.015 | 12 | 0,16 |
| Banco Santander S.A. | 37.470 | 153 | 2,05 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Europe Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| CaixaBank S.A. | 996 | € | 2 | 0,03 |
| Mapfre S.A. | 3.149 | | 8 | 0,11 |
| Unicaja Banco S.A. | 5.370 | | 4 | 0,05 |
| | | | 217 | 2,91 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. | 1.011 | | 36 | 0,48 |
| Ferrovial S.A. | 700 | | 16 | 0,21 |
| Obrascon Huarte Lain S.A. | 3.552 | | 4 | 0,05 |
| | | | 56 | 0,74 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| Enagas S.A. | 174 | | 4 | 0,05 |
| Endesa S.A. | 1.728 | | 39 | 0,52 |
| Iberdrola S.A. | 8.692 | | 76 | 1,02 |
| Naturgy Energy Group S.A. | 1.140 | | 28 | 0,37 |
| | | | 147 | 1,96 |
| Summe Spanien | | | 576 | 7,70 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| Tele2 AB 'B' | 567 | | 8 | 0,10 |
| Telia Co. AB | 6.221 | | 24 | 0,32 |
| | | | 32 | 0,42 |
| **LUXUSGÜTER** | | | | |
| Autoliv, Inc. | 38 | | 2 | 0,03 |
| Electrolux AB 'B' | 322 | | 7 | 0,09 |
| Hennes & Mauritz AB 'B' | 1.450 | | 23 | 0,31 |
| | | | 32 | 0,43 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| Swedish Match AB | 165 | | 6 | 0,08 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| Industrivarden AB 'C' | 228 | | 4 | 0,05 |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | 2.141 | | 17 | 0,23 |
| Svenska Handelsbanken AB 'A' | 1.591 | | 14 | 0,19 |
| Swedbank AB 'A' | 1.270 | | 17 | 0,23 |
| | | | 52 | 0,70 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | | |
| Getinge AB 'B' | 729 | | 10 | 0,14 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Sandvik AB | 637 | | 10 | 0,14 |
| Securitas AB 'B' | 49 | | 1 | 0,01 |
| Skanska AB 'B' | 321 | | 5 | 0,07 |
| SKF AB 'B' | 632 | | 10 | 0,13 |
| Volvo AB 'B' | 474 | | 7 | 0,09 |
| | | | 33 | 0,44 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | | |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | 6.335 | | 53 | 0,71 |
| Summe Schweden | | | 218 | 2,92 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| Swisscom AG | 31 | | 14 | 0,18 |
| **LUXUSGÜTER** | | | | |
| Cie Financiere Richemont S.A. | 148 | | 11 | 0,15 |
| Dufry AG | 51 | | 4 | 0,05 |
| Garmin Ltd. | 157 | | 11 | 0,15 |
| Swatch Group AG | 26 | | 6 | 0,08 |
| | | | 32 | 0,43 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| Aryzta AG (a) | 1.476 | € | 1 | 0,02 |
| Nestle S.A. | 1.757 | | 160 | 2,14 |
| | | | 161 | 2,16 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| Baloise Holding AG | 42 | | 7 | 0,09 |
| Credit Suisse Group AG | 1.859 | | 20 | 0,27 |
| Helvetia Holding AG | 85 | | 9 | 0,12 |
| Swiss Life Holding AG | 96 | | 42 | 0,56 |
| Swiss Re AG | 827 | | 74 | 0,99 |
| UBS Group AG | 4.151 | | 43 | 0,58 |
| Zurich Insurance Group AG | 294 | | 90 | 1,20 |
| | | | 285 | 3,81 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | | |
| Alcon, Inc. (a) | 266 | | 15 | 0,20 |
| Novartis AG | 1.632 | | 131 | 1,75 |
| Roche Holding AG | 494 | | 122 | 1,63 |
| | | | 268 | 3,58 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| ABB Ltd. | 1.870 | | 33 | 0,44 |
| Adecco Group AG | 361 | | 19 | 0,26 |
| Kuehne + Nagel International AG | 36 | | 4 | 0,05 |
| SGS S.A. | 3 | | 7 | 0,09 |
| Sulzer AG | 51 | | 5 | 0,07 |
| | | | 68 | 0,91 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | | |
| TE Connectivity Ltd. | 97 | | 8 | 0,11 |
| **BAUSTOFFE** | | | | |
| Glencore PLC | 1.169 | | 4 | 0,05 |
| LafargeHolcim Ltd. | 468 | | 20 | 0,27 |
| | | | 24 | 0,32 |
| **IMMOBILIEN** | | | | |
| Swiss Prime Site AG | 41 | | 3 | 0,04 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| BKW AG | 47 | | 3 | 0,04 |
| Summe Schweiz | | | 866 | 11,58 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| BT Group PLC | 14.443 | | 32 | 0,43 |
| Inmarsat PLC | 583 | | 4 | 0,05 |
| ITV PLC | 5.649 | | 7 | 0,09 |
| Pearson PLC | 2.073 | | 19 | 0,25 |
| Vodafone Group PLC | 32.668 | | 47 | 0,63 |
| WPP PLC | 3.283 | | 36 | 0,48 |
| | | | 145 | 1,93 |
| **LUXUSGÜTER** | | | | |
| Barratt Developments PLC | 347 | | 2 | 0,03 |
| Berkeley Group Holdings PLC | 194 | | 8 | 0,11 |
| Burberry Group PLC | 366 | | 8 | 0,11 |
| Compass Group PLC | 1.318 | | 28 | 0,38 |
| Dixons Carphone PLC | 896 | | 1 | 0,01 |
| Fiat Chrysler Automobiles NV | 2.327 | | 28 | 0,37 |
| Greene King PLC | 1.270 | | 9 | 0,12 |
| Inchcape PLC | 927 | | 6 | 0,08 |
| InterContinental Hotels Group PLC | 91 | | 5 | 0,07 |
| Kingfisher PLC | 7.514 | | 18 | 0,24 |
| Marks & Spencer Group PLC | 8.392 | | 20 | 0,27 |
| Next PLC | 235 | | 15 | 0,20 |
| Persimmon PLC | 31 | | 1 | 0,01 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| Sports Direct International PLC | 701 | € | 2 | 0,03 |
| Taylor Wimpey PLC | 3.234 | | 6 | 0,08 |
| Thomas Cook Group PLC | 9.410 | | 1 | 0,01 |
| Whitbread PLC | 142 | | 7 | 0,09 |
| William Hill PLC | 3.824 | | 7 | 0,09 |
| | | | 172 | 2,30 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| British American Tobacco PLC | 825 | | 26 | 0,34 |
| Diageo PLC | 854 | | 32 | 0,43 |
| Imperial Brands PLC | 1.820 | | 38 | 0,51 |
| J Sainsbury PLC | 7.474 | | 16 | 0,21 |
| Reckitt Benckiser Group PLC | 419 | | 29 | 0,39 |
| Tate & Lyle PLC | 1.107 | | 9 | 0,12 |
| Tesco PLC | 2.337 | | 6 | 0,08 |
| Unilever NV | 600 | | 32 | 0,43 |
| Unilever PLC | 478 | | 26 | 0,35 |
| WM Morrison Supermarkets PLC | 5.170 | | 12 | 0,16 |
| | | | 226 | 3,02 |
| **ENERGIE** | | | | |
| BP PLC | 25.549 | | 157 | 2,10 |
| Petrofac Ltd. | 485 | | 2 | 0,03 |
| Subsea 7 S.A. | 665 | | 7 | 0,09 |
| | | | 166 | 2,22 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| 3i Group PLC | 451 | | 6 | 0,08 |
| Admiral Group PLC | 151 | | 4 | 0,05 |
| Aviva PLC | 7.708 | | 36 | 0,48 |
| Barclays PLC | 39.246 | | 66 | 0,88 |
| CYBG PLC | 1.679 | | 3 | 0,04 |
| Direct Line Insurance Group PLC | 4.908 | | 18 | 0,24 |
| HSBC Holdings PLC | 20.235 | | 149 | 1,99 |
| Intermediate Capital Group PLC | 204 | | 3 | 0,04 |
| Legal & General Group PLC | 3.721 | | 11 | 0,15 |
| Lloyds Banking Group PLC | 96.918 | | 61 | 0,82 |
| Provident Financial PLC | 723 | | 3 | 0,04 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC | 2.923 | | 7 | 0,10 |
| Standard Chartered PLC | 5.139 | | 41 | 0,55 |
| | | | 408 | 5,46 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | | |
| AstraZeneca PLC | 1.390 | | 100 | 1,34 |
| GlaxoSmithKline PLC | 6.543 | | 115 | 1,54 |
| Smith & Nephew PLC | 258 | | 5 | 0,07 |
| | | | 220 | 2,95 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Aggreko PLC | 463 | | 4 | 0,05 |
| BAE Systems PLC | 5.434 | | 30 | 0,40 |
| Capita PLC (a) | 6.280 | | 7 | 0,09 |
| CNH Industrial NV | 1.128 | | 10 | 0,13 |
| easyJet PLC | 674 | | 7 | 0,09 |
| Experian PLC | 335 | | 9 | 0,12 |
| Ferguson PLC | 337 | | 21 | 0,28 |
| Firstgroup PLC (a) | 4.579 | | 5 | 0,07 |
| G4S PLC | 2.102 | | 5 | 0,07 |
| IMI PLC | 409 | | 5 | 0,07 |
| International Consolidated Airlines Group S.A. | 1.732 | | 9 | 0,12 |
| Meggitt PLC | 1.327 | | 8 | 0,11 |
| National Express Group PLC | 1.198 | | 5 | 0,07 |
| RELX PLC | 225 | | 5 | 0,07 |
| Rentokil Initial PLC | 1.013 | | 5 | 0,07 |
| Rolls-Royce Holdings PLC | 1.736 | | 16 | 0,21 |
| Royal Mail PLC | 9.674 | | 23 | 0,31 |
| Smiths Group PLC | 217 | | 4 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Stagecoach Group PLC | 2.759 | € 4 | 0,05 |
| Travis Perkins PLC | 315 | 5 | 0,07 |
| | | 187 | 2,50 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Micro Focus International PLC | 169 | 4 | 0,05 |
| Sage Group PLC | 799 | 7 | 0,10 |
| | | 11 | 0,15 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Anglo American PLC | 248 | 6 | 0,08 |
| BHP Group PLC | 1.487 | 33 | 0,44 |
| DS Smith PLC | 1.227 | 5 | 0,07 |
| Johnson Matthey PLC | 107 | 4 | 0,05 |
| Mondi PLC | 232 | 5 | 0,07 |
| Rio Tinto PLC | 1.171 | 64 | 0,85 |
| | | 117 | 1,56 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Centrica PLC | 31.372 | 31 | 0,42 |
| National Grid PLC | 6.664 | 62 | 0,83 |
| Severn Trent PLC | 381 | 9 | 0,12 |
| SSE PLC | 1.650 | € 21 | 0,28 |
| United Utilities Group PLC | 1.180 | 10 | 0,13 |
| | | 133 | 1,78 |
| Summe Großbritannien | | 1.785 | 23,87 |
| **USA** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Carnival PLC | 80 | 3 | 0,04 |
| Summe Stammaktien | | 7.288 | 97,47 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Schaeffler AG | 658 | 4 | 0,06 |
| Volkswagen AG | 514 | 76 | 1,02 |
| | | 80 | 1,08 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | |
| British Land Co. PLC | 810 | 5 | 0,07 |
| Intu Properties PLC | 4.501 | 4 | 0,05 |
| Klepierre S.A. | 173 | 5 | 0,07 |
| Land Securities Group PLC | 1.081 | 10 | 0,13 |
| Segro PLC | 99 | 1 | 0,01 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | 25 | 0,33 |
| **RECHTE** | | | |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. - Exp. 11.07.2019 | 1.011 | € 2 | 0,02 |
| Repsol S.A. - Exp. 09.07.2019 | 2.001 | 1 | 0,01 |
| Sacyr S.A. - Exp. 05.07.2019 | 1.920 | 0 | 0,00 |
| | | 3 | 0,03 |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | |
| Abengoa S.A. 'B' - Exp. 31.03.2025 | 24.248 | 0 | 0,00 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **€ 7.396** | **98,91** |
| **Summe Anlagen** | | **€ 7.396** | **98,91** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **€ 81** | **1,09** |
| **Nettovermögen** | | **€ 7.477** | **100,00** |

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

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

**(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 417 | € 6.979 | € 0 | € 7.396 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 156 | € 7.905 | € 0 | € 8.061 |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 98,91 | 99,20 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Stammaktien | | |
| Österreich | 0,58 | 0,78 |
| Belgien | 1,14 | 1,12 |
| Dänemark | 0,98 | 0,87 |
| Finnland | 0,98 | 1,02 |
| Frankreich | 18,43 | 18,35 |
| Deutschland | 13,68 | 12,94 |
| Irland | 1,42 | 1,29 |
| Italien | 6,37 | 5,69 |
| Luxemburg | 0,29 | 0,27 |
| Niederlande | 5,53 | 5,96 |
| Norwegen | 1,26 | 1,42 |
| Portugal | 0,52 | 0,53 |
| Südafrika | 0,18 | 0,38 |
| Spanien | 7,70 | 6,85 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Schweden | 2,92 | 2,75 |
| Schweiz | 11,58 | 11,08 |
| Großbritannien | 23,87 | 25,89 |
| Vereinigte Staaten | 0,04 | 0,21 |
| Vorzugsaktien | 1,08 | 1,24 |
| Real Estate Investment Trusts | 0,33 | 0,55 |
| Bezugsrechte | 0,03 | 0,01 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 1,09 | 0,80 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/ GEREGELTER MARKT** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telstra Corp. Ltd. | 46.699 | $ 126 | 0,24 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Crown Resorts Ltd. | 1.223 | 11 | 0,02 |
| Wesfarmers Ltd. | 2.143 | 54 | 0,11 |
| | | 65 | 0,13 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Coca-Cola Amatil Ltd. | 3.227 | 23 | 0,04 |
| Coles Group Ltd. (a) | 1.435 | 14 | 0,03 |
| Woolworths Group Ltd. | 4.420 | 103 | 0,20 |
| | | 140 | 0,27 |
| **ENERGIE** | | | |
| Woodside Petroleum Ltd. | 2.350 | 60 | 0,12 |
| WorleyParsons Ltd. | 1.191 | 13 | 0,02 |
| | | 73 | 0,14 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| AMP Ltd. | 19.002 | 28 | 0,05 |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. | 8.481 | 168 | 0,33 |
| Bendigo & Adelaide Bank Ltd. | 1.626 | 13 | 0,03 |
| Commonwealth Bank of Australia | 3.071 | 179 | 0,35 |
| Macquarie Group Ltd. | 1.005 | 89 | 0,17 |
| National Australia Bank Ltd. | 8.384 | 157 | 0,30 |
| QBE Insurance Group Ltd. | 1.189 | 10 | 0,02 |
| Suncorp Group Ltd. | 6.503 | 62 | 0,12 |
| Westpac Banking Corp. | 8.775 | 175 | 0,34 |
| | | 881 | 1,71 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Aurizon Holdings Ltd. | 7.458 | 28 | 0,06 |
| Downer EDI Ltd. | 4.369 | 21 | 0,04 |
| | | 49 | 0,10 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| BHP Group Ltd. | 4.063 | 118 | 0,22 |
| Fortescue Metals Group Ltd. | 2.962 | 19 | 0,04 |
| | | 137 | 0,26 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| APA Group | 1.422 | 11 | 0,02 |
| Summe Australien | | 1.482 | 2,87 |
| **ÖSTERREICH** | | | |
| **ENERGIE** | | | |
| OMV AG | 276 | 14 | 0,03 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Erste Group Bank AG | 1.074 | 40 | 0,08 |
| Raiffeisen Bank International AG | 529 | 12 | 0,02 |
| | | 52 | 0,10 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| voestalpine AG | 714 | 22 | 0,04 |
| Summe Österreich | | 88 | 0,17 |
| **BELGIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Proximus SADP | 1.088 | 32 | 0,06 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Anheuser-Busch InBev S.A. NV | 130 | $ 11 | 0,02 |
| Colruyt S.A. | 139 | 8 | 0,02 |
| | | 19 | 0,04 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Ageas | 1.292 | 67 | 0,13 |
| KBC Group NV | 450 | 30 | 0,06 |
| | | 97 | 0,19 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| bpost S.A. | 485 | 5 | 0,01 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Solvay S.A. | 201 | 21 | 0,04 |
| Summe Belgien | | 174 | 0,34 |
| **KANADA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| BCE, Inc. | 710 | 32 | 0,06 |
| Shaw Communications, Inc. 'B' | 1.032 | 21 | 0,04 |
| TELUS Corp. | 992 | 37 | 0,07 |
| Thomson Reuters Corp. | 1.220 | 79 | 0,16 |
| | | 169 | 0,33 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Canadian Tire Corp. Ltd. 'A' | 261 | 28 | 0,06 |
| Magna International, Inc. | 1.662 | 83 | 0,16 |
| | | 111 | 0,22 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Empire Co. Ltd. 'A' | 630 | 16 | 0,03 |
| George Weston Ltd. | 400 | 30 | 0,06 |
| Loblaw Cos. Ltd. | 448 | 23 | 0,04 |
| | | 69 | 0,13 |
| **ENERGIE** | | | |
| ARC Resources Ltd. | 1.077 | 5 | 0,01 |
| Baytex Energy Corp. (a) | 6.138 | 10 | 0,02 |
| Canadian Natural Resources Ltd. | 1.394 | 38 | 0,07 |
| Cenovus Energy, Inc. | 3.550 | 31 | 0,06 |
| Crescent Point Energy Corp. | 13.415 | 44 | 0,09 |
| Enbridge, Inc. | 281 | 10 | 0,02 |
| Husky Energy, Inc. | 2.733 | 26 | 0,05 |
| Imperial Oil Ltd. | 527 | 15 | 0,03 |
| MEG Energy Corp. (a) | 2.208 | 9 | 0,02 |
| Precision Drilling Corp. (a) | 3.886 | 7 | 0,01 |
| Suncor Energy, Inc. | 4.523 | 141 | 0,27 |
| TC Energy Corp. | 485 | 24 | 0,05 |
| | | 360 | 0,70 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bank of Montreal | 1.998 | 151 | 0,29 |
| Bank of Nova Scotia | 2.708 | 146 | 0,28 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | 1.299 | 102 | 0,20 |
| National Bank of Canada | 609 | 29 | 0,06 |
| Onex Corp. | 505 | 31 | 0,06 |
| Power Corp. of Canada | 2.172 | 47 | 0,09 |
| Power Financial Corp. | 577 | 13 | 0,02 |
| Royal Bank of Canada | 2.379 | 190 | 0,37 |
| Sun Life Financial, Inc. | 600 | 25 | 0,05 |
| Toronto-Dominion Bank | 3.349 | 196 | 0,37 |
| | | 930 | 1,79 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Air Canada (a) | 2.706 | 82 | 0,16 |
| Canadian National Railway Co. | 808 | 75 | 0,15 |
| Canadian Pacific Railway Ltd. | 250 | $ 59 | 0,11 |
| TFI International, Inc. | 478 | 15 | 0,03 |
| WestJet Airlines Ltd. | 1.241 | 29 | 0,06 |
| WSP Global, Inc. | 307 | 17 | 0,03 |
| | | 277 | 0,54 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Eldorado Gold Corp. (a) | 2.151 | 13 | 0,03 |
| Yamana Gold, Inc. | 8.751 | 22 | 0,04 |
| | | 35 | 0,07 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Atco Ltd. 'I' | 318 | 11 | 0,02 |
| Canadian Utilities Ltd. 'A' | 390 | 11 | 0,02 |
| Capital Power Corp. | 452 | 10 | 0,02 |
| Hydro One Ltd. | 1.643 | 29 | 0,06 |
| TransAlta Corp. | 1.701 | 11 | 0,02 |
| | | 72 | 0,14 |
| Summe Kanada | | 2.023 | 3,92 |
| **DÄNEMARK** | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Carlsberg A/S 'B' | 133 | 18 | 0,04 |
| **ENERGIE** | | | |
| Drilling Co. of 1972 A/S (a) | 56 | 4 | 0,01 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Novo Nordisk A/S 'B' | 508 | 26 | 0,05 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| AP Moller - Maersk A/S 'B' | 28 | 35 | 0,07 |
| ISS A/S | 1.639 | 49 | 0,09 |
| | | 84 | 0,16 |
| Summe Dänemark | | 132 | 0,26 |
| **FINNLAND** | | | |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Nordea Bank Abp | 6.968 | 50 | 0,10 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Nokia Oyj | 1.590 | 8 | 0,02 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Stora Enso Oyj 'R' | 1.724 | 20 | 0,04 |
| UPM-Kymmene Oyj | 1.190 | 32 | 0,06 |
| | | 52 | 0,10 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Fortum Oyj | 1.388 | 31 | 0,06 |
| Summe Finnland | | 141 | 0,28 |
| **FRANKREICH** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Eutelsat Communications S.A. | 562 | 11 | 0,02 |
| Lagardere S.C.A. | 1.496 | 39 | 0,08 |
| Orange S.A. | 11.803 | 186 | 0,36 |
| Publicis Groupe S.A. | 435 | 23 | 0,05 |
| Vivendi S.A. | 1.893 | 52 | 0,10 |
| | | 311 | 0,61 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Cie Generale des Etablissements Michelin S.C.A. | 597 | 76 | 0,15 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 156 | 66 | 0,13 |
| Peugeot S.A. | 1.483 | 37 | 0,07 |
| Renault S.A. | 872 | 55 | 0,10 |
| | | 234 | 0,45 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Global Developed Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Carrefour S.A. | 6.817 | $ 132 | 0,25 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 1.754 | 60 | 0,12 |
| Danone S.A. | 131 | 11 | 0,02 |
| L'Oreal S.A. | 120 | 34 | 0,07 |
| | | 237 | 0,46 |
| **ENERGIE** | | | |
| CGG S.A. (a) | 6.271 | 12 | 0,02 |
| Total S.A. | 5.600 | 314 | 0,61 |
| | | 326 | 0,63 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| AXA S.A. | 6.114 | 161 | 0,31 |
| BNP Paribas S.A. | 4.425 | 210 | 0,41 |
| Credit Agricole S.A. | 1.756 | 21 | 0,04 |
| SCOR SE | 561 | 25 | 0,05 |
| Societe Generale S.A. | 6.855 | 173 | 0,33 |
| | | 590 | 1,14 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Sanofi | 4.041 | 350 | 0,68 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Air France-KLM (a) | 9.968 | 96 | 0,18 |
| Airbus SE | 92 | 13 | 0,02 |
| Alstom S.A. | 325 | 15 | 0,03 |
| Bouygues S.A. | 1.611 | 60 | 0,12 |
| Cie de Saint-Gobain | 2.438 | 95 | 0,18 |
| Eiffage S.A. | 295 | 29 | 0,06 |
| Rexel S.A. | 2.757 | 35 | 0,07 |
| Safran S.A. | 172 | 25 | 0,05 |
| Schneider Electric SE | 923 | 84 | 0,16 |
| Vinci S.A. | 891 | 91 | 0,18 |
| | | 543 | 1,05 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Atos SE | 447 | 37 | 0,07 |
| Capgemini SE | 160 | 20 | 0,04 |
| | | 57 | 0,11 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Electricite de France S.A. | 7.563 | 95 | 0,18 |
| Engie S.A. | 13.930 | 212 | 0,41 |
| Suez | 3.493 | 50 | 0,10 |
| Veolia Environnement S.A. | 1.869 | 46 | 0,09 |
| | | 403 | 0,78 |
| Summe Frankreich | | 3.051 | 5,91 |
| **DEUTSCHLAND** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Deutsche Telekom AG | 13.036 | 226 | 0,44 |
| ProSiebenSat.1 Media SE | 1.955 | 31 | 0,06 |
| | | 257 | 0,50 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| adidas AG | 35 | 11 | 0,02 |
| Bayerische Motoren Werke AG | 1.709 | 126 | 0,24 |
| Ceconomy AG | 2.063 | 13 | 0,03 |
| Continental AG | 137 | 20 | 0,04 |
| Daimler AG | 4.362 | 244 | 0,47 |
| Hugo Boss AG | 240 | 16 | 0,03 |
| | | 430 | 0,83 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| METRO AG | 4.019 | 73 | 0,14 |
| Suedzucker AG | 652 | 11 | 0,02 |
| | | 84 | 0,16 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Aareal Bank AG | 330 | $ 9 | 0,02 |
| Commerzbank AG | 8.645 | 62 | 0,12 |
| Deutsche Bank AG | 21.227 | 164 | 0,32 |
| Deutsche Pfandbriefbank AG | 836 | 10 | 0,02 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 772 | 194 | 0,37 |
| | | 439 | 0,85 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Bayer AG | 2.165 | 151 | 0,29 |
| Fresenius SE & Co. KGaA | 152 | 8 | 0,02 |
| | | 159 | 0,31 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Deutsche Lufthansa AG | 4.261 | 73 | 0,14 |
| Deutsche Post AG | 3.096 | 102 | 0,20 |
| Siemens AG | 1.189 | 142 | 0,27 |
| | | 317 | 0,61 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| SAP SE | 211 | 29 | 0,06 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| BASF SE | 1.976 | 144 | 0,28 |
| Evonik Industries AG | 836 | 24 | 0,05 |
| K+S AG | 1.196 | 22 | 0,04 |
| Salzgitter AG | 331 | 10 | 0,02 |
| | | 200 | 0,39 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| E.ON SE | 8.530 | 92 | 0,18 |
| Innogy SE | 718 | 34 | 0,07 |
| RWE AG | 5.736 | 142 | 0,27 |
| | | 268 | 0,52 |
| Summe Deutschland | | 2.183 | 4,23 |
| **HONGKONG** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| HKT Trust & HKT Ltd. | 6.000 | 9 | 0,02 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| SJM Holdings Ltd. | 31.000 | 35 | 0,07 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| CK Hutchison Holdings Ltd. | 3.000 | 30 | 0,06 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| CK Asset Holdings Ltd. | 2.500 | 20 | 0,04 |
| Hongkong Land Holdings Ltd. | 3.400 | 22 | 0,04 |
| New World Development Co. Ltd. | 24.000 | 37 | 0,07 |
| Shimao Property Holdings Ltd. | 8.500 | 26 | 0,05 |
| Sun Hung Kai Properties Ltd. | 3.000 | 51 | 0,10 |
| Swire Pacific Ltd. 'A' | 3.500 | 43 | 0,08 |
| Wharf Holdings Ltd. | 7.000 | 18 | 0,04 |
| | | 217 | 0,42 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| CLP Holdings Ltd. | 2.500 | 28 | 0,05 |
| Summe Hongkong | | 319 | 0,62 |
| **IRLAND** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Aptiv PLC | 126 | 10 | 0,02 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bank of Ireland Group PLC | 4.212 | 22 | 0,04 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Medtronic PLC | 954 | $ 93 | 0,17 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| AerCap Holdings NV (a) | 572 | 30 | 0,06 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| CRH PLC | 1.219 | 40 | 0,08 |
| Smurfit Kappa Group PLC | 988 | 30 | 0,06 |
| | | 70 | 0,14 |
| Summe Irland | | 225 | 0,43 |
| **ISRAEL** | | | |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bank Hapoalim BM | 3.904 | 29 | 0,06 |
| Bank Leumi Le-Israel BM | 5.964 | 43 | 0,08 |
| Israel Discount Bank Ltd. 'A' | 2.799 | 12 | 0,02 |
| | | 84 | 0,16 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Teva Pharmaceutical Industries Ltd. SP - ADR (a) | 6.858 | 63 | 0,13 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Israel Chemicals Ltd. | 4.040 | 21 | 0,04 |
| Summe Israel | | 168 | 0,33 |
| **ITALIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telecom Italia SpA | 160.478 | 88 | 0,17 |
| **ENERGIE** | | | |
| Eni SpA | 13.668 | 228 | 0,44 |
| Saipem SpA (a) | 2.038 | 10 | 0,02 |
| | | 238 | 0,46 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Assicurazioni Generali SpA | 5.330 | 100 | 0,19 |
| Banco BPM SpA (a) | 17.033 | 35 | 0,07 |
| BPER Banca | 4.965 | 20 | 0,04 |
| Intesa Sanpaolo SpA | 25.116 | 54 | 0,11 |
| Poste Italiane SpA | 10.415 | 110 | 0,21 |
| UniCredit SpA | 1.801 | 22 | 0,04 |
| Unione di Banche Italiane SpA | 6.891 | 19 | 0,04 |
| Unipol Gruppo Finanziario SpA | 7.282 | 36 | 0,07 |
| | | 396 | 0,77 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Leonardo SpA | 2.006 | 25 | 0,05 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Enel SpA | 32.040 | 224 | 0,43 |
| Snam SpA | 2.051 | 10 | 0,02 |
| | | 234 | 0,45 |
| Summe Italien | | 981 | 1,90 |
| **JAPAN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Dentsu, Inc. | 300 | 11 | 0,02 |
| Fuji Media Holdings, Inc. | 1.600 | 22 | 0,04 |
| KDDI Corp. | 4.000 | 102 | 0,20 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp. | 4.600 | 214 | 0,42 |
| NTT DOCOMO, Inc. | 3.300 | 77 | 0,15 |
| SoftBank Group Corp. | 1.400 | 68 | 0,13 |
| | | 494 | 0,96 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Aisin Seiki Co. Ltd. | 400 | 14 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Bridgestone Corp. | 1.900 | $ 75 | 0,14 |
| Denso Corp. | 400 | 17 | 0,03 |
| Honda Motor Co. Ltd. | 6.200 | 160 | 0,31 |
| Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd. | 2.700 | 22 | 0,04 |
| Mazda Motor Corp. | 5.100 | 53 | 0,10 |
| Nikon Corp. | 1.200 | 17 | 0,03 |
| Nissan Motor Co. Ltd. | 15.800 | 113 | 0,22 |
| Panasonic Corp. | 3.500 | 29 | 0,06 |
| Sekisui Chemical Co. Ltd. | 1.400 | 21 | 0,04 |
| Sekisui House Ltd. | 1.800 | 30 | 0,06 |
| Skylark Co. Ltd. | 1.200 | 21 | 0,04 |
| Sony Corp. | 900 | 47 | 0,09 |
| Subaru Corp. | 1.600 | 39 | 0,08 |
| Sumitomo Electric Industries Ltd. | 3.000 | 39 | 0,08 |
| Sumitomo Rubber Industries Ltd. | 700 | 8 | 0,02 |
| Suzuki Motor Corp. | 400 | 19 | 0,04 |
| Takashimaya Co. Ltd. | 1.900 | 21 | 0,04 |
| Toyota Motor Corp. | 4.100 | 255 | 0,49 |
| Yamada Denki Co. Ltd. | 5.800 | 26 | 0,05 |
| | | 1.026 | 1,99 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Aeon Co. Ltd. | 5.900 | 102 | 0,20 |
| Ajinomoto Co., Inc. | 1.200 | 21 | 0,04 |
| Japan Tobacco, Inc. | 2.800 | 62 | 0,12 |
| Kao Corp. | 200 | 15 | 0,03 |
| Kirin Holdings Co. Ltd. | 2.200 | 47 | 0,09 |
| MEIJI Holdings Co. Ltd. | 200 | 14 | 0,03 |
| NH Foods Ltd. | 400 | 17 | 0,03 |
| Nippon Suisan Kaisha Ltd. | 1.700 | 11 | 0,02 |
| Seven & i Holdings Co. Ltd. | 2.000 | 68 | 0,13 |
| Suntory Beverage & Food Ltd. | 200 | 9 | 0,02 |
| Yamazaki Baking Co. Ltd. | 1.200 | 18 | 0,03 |
| | | 384 | 0,74 |
| **ENERGIE** | | | |
| Cosmo Energy Holdings Co. Ltd. | 500 | 11 | 0,02 |
| Inpex Corp. | 7.300 | 66 | 0,13 |
| JXTG Holdings, Inc. | 7.200 | 36 | 0,07 |
| | | 113 | 0,22 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Concordia Financial Group Ltd. | 3.500 | 13 | 0,03 |
| Dai-ichi Life Holdings, Inc. | 5.100 | 77 | 0,15 |
| Daiwa Securities Group, Inc. | 6.300 | 28 | 0,05 |
| Japan Post Bank Co. Ltd. | 3.700 | 38 | 0,07 |
| Japan Post Holdings Co. Ltd. | 8.700 | 99 | 0,19 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | 45.300 | 216 | 0,41 |
| Mizuho Financial Group, Inc. | 120.300 | 175 | 0,34 |
| MS&AD Insurance Group Holdings, Inc. | 1.700 | 54 | 0,10 |
| Nomura Holdings, Inc. | 8.300 | 29 | 0,06 |
| ORIX Corp. | 4.300 | 64 | 0,12 |
| Resona Holdings, Inc. | 9.100 | 38 | 0,07 |
| SBI Holdings, Inc. | 700 | 17 | 0,03 |
| Shinsei Bank Ltd. | 700 | 11 | 0,02 |
| Shizuoka Bank Ltd. | 1.800 | 13 | 0,03 |
| Sompo Holdings, Inc. | 500 | 19 | 0,04 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | 4.400 | 156 | 0,30 |
| Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc. | 1.500 | 55 | 0,11 |
| Suruga Bank Ltd. | 4.400 | 17 | 0,03 |
| T&D Holdings, Inc. | 1.900 | 21 | 0,04 |
| Tokio Marine Holdings, Inc. | 900 | 45 | 0,09 |
| | | 1.185 | 2,28 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Alfresa Holdings Corp. | 600 | $ 15 | 0,03 |
| Astellas Pharma, Inc. | 5.500 | 78 | 0,15 |
| Daiichi Sankyo Co. Ltd. | 1.500 | 79 | 0,15 |
| Otsuka Holdings Co. Ltd. | 1.100 | 36 | 0,07 |
| Suzuken Co. Ltd. | 200 | 12 | 0,02 |
| Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. | 800 | 28 | 0,06 |
| | | 248 | 0,48 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ANA Holdings, Inc. | 400 | 13 | 0,03 |
| Asahi Glass Co. Ltd. | 1.000 | 35 | 0,07 |
| Central Japan Railway Co. | 100 | 20 | 0,04 |
| Dai Nippon Printing Co. Ltd. | 1.600 | 34 | 0,07 |
| East Japan Railway Co. | 1.000 | 94 | 0,18 |
| Fuji Electric Co. Ltd. | 300 | 10 | 0,02 |
| Fujikura Ltd. | 2.300 | 9 | 0,02 |
| ITOCHU Corp. | 4.100 | 79 | 0,15 |
| Japan Airlines Co. Ltd. | 1.200 | 38 | 0,07 |
| Kawasaki Heavy Industries Ltd. | 1.000 | 24 | 0,05 |
| Kubota Corp. | 600 | 10 | 0,02 |
| LIXIL Group Corp. | 1.900 | 30 | 0,06 |
| Marubeni Corp. | 9.200 | 61 | 0,12 |
| Mitsubishi Corp. | 2.500 | 66 | 0,13 |
| Mitsubishi Electric Corp. | 4.600 | 61 | 0,12 |
| Mitsubishi Heavy Industries Ltd. | 2.400 | 105 | 0,20 |
| Mitsui & Co. Ltd. | 4.900 | 80 | 0,16 |
| Nippon Express Co. Ltd. | 100 | 5 | 0,01 |
| Nippon Sheet Glass Co. Ltd. | 1.800 | 12 | 0,02 |
| Nippon Yusen KK | 2.000 | 32 | 0,06 |
| NSK Ltd. | 1.200 | 11 | 0,02 |
| NTN Corp. | 3.100 | 9 | 0,02 |
| Secom Co. Ltd. | 200 | 17 | 0,03 |
| Sojitz Corp. | 8.000 | 26 | 0,05 |
| Sumitomo Corp. | 3.600 | 55 | 0,11 |
| Tokyu Corp. | 1.300 | 23 | 0,04 |
| Toppan Printing Co. Ltd. | 1.700 | 26 | 0,05 |
| Toshiba Corp. | 1.200 | 37 | 0,07 |
| Toyota Tsusho Corp. | 400 | 12 | 0,02 |
| West Japan Railway Co. | 600 | 49 | 0,09 |
| | | 1.083 | 2,10 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Brother Industries Ltd. | 600 | 11 | 0,02 |
| Canon, Inc. | 2.400 | 70 | 0,14 |
| FUJIFILM Holdings Corp. | 2.000 | 102 | 0,20 |
| Fujitsu Ltd. | 1.500 | 105 | 0,20 |
| Hitachi Ltd. | 6.400 | 236 | 0,46 |
| Japan Display, Inc. (a) | 19.000 | 13 | 0,03 |
| Konica Minolta, Inc. | 5.800 | 56 | 0,11 |
| Kyocera Corp. | 500 | 33 | 0,06 |
| Mixi, Inc. | 500 | 10 | 0,02 |
| Murata Manufacturing Co. Ltd. | 200 | 9 | 0,02 |
| NEC Corp. | 1.900 | 75 | 0,14 |
| Ricoh Co. Ltd. | 7.300 | 73 | 0,14 |
| Seiko Epson Corp. | 700 | 11 | 0,02 |
| TDK Corp. | 400 | 31 | 0,06 |
| | | 835 | 1,62 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Asahi Kasei Corp. | 3.000 | 32 | 0,06 |
| DIC Corp. | 400 | 11 | 0,02 |
| JFE Holdings, Inc. | 400 | 6 | 0,01 |
| Kaneka Corp. | 200 | 7 | 0,02 |
| Kobe Steel Ltd. | 4.000 | 26 | 0,05 |
| Mitsubishi Chemical Holdings Corp. | 7.500 | 53 | 0,10 |
| Mitsubishi Materials Corp. | 600 | 17 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Nippon Paper Industries Co. Ltd. 'L' | 900 | $ 16 | 0,03 |
| Nippon Steel Corp. | 1.100 | 19 | 0,04 |
| Oji Holdings Corp. | 4.600 | 27 | 0,05 |
| Sumitomo Chemical Co. Ltd. | 7.000 | 33 | 0,07 |
| Taiheiyo Cement Corp. | 300 | 9 | 0,02 |
| Teijin Ltd. | 600 | 10 | 0,02 |
| Toyo Seikan Group Holdings Ltd. | 1.100 | 22 | 0,04 |
| | | 288 | 0,56 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Mitsui Fudosan Co. Ltd. | 400 | 10 | 0,02 |
| Tokyu Fudosan Holdings Corp. | 1.300 | 7 | 0,01 |
| | | 17 | 0,03 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Chubu Electric Power Co., Inc. | 4.100 | 58 | 0,11 |
| Chugoku Electric Power Co., Inc. | 3.200 | 40 | 0,08 |
| Electric Power Development Co. Ltd. 'C' | 900 | 21 | 0,04 |
| Hokuriku Electric Power Co. | 1.800 | 13 | 0,02 |
| Kansai Electric Power Co., Inc. | 4.900 | 56 | 0,11 |
| Kyushu Electric Power Co., Inc. | 3.800 | 37 | 0,07 |
| Osaka Gas Co. Ltd. | 500 | 9 | 0,02 |
| Shikoku Electric Power Co., Inc. | 1.000 | 9 | 0,02 |
| Tohoku Electric Power Co., Inc. | 2.400 | 24 | 0,05 |
| Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc. (a) | 31.300 | 164 | 0,32 |
| Tokyo Gas Co. Ltd. | 500 | 12 | 0,02 |
| | | 443 | 0,86 |
| Summe Japan | | 6.116 | 11,84 |
| **LUXEMBURG** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| RTL Group S.A. | 310 | 16 | 0,03 |
| SES S.A. | 1.655 | 26 | 0,05 |
| | | 42 | 0,08 |
| Summe Luxemburg | | 42 | 0,08 |
| **NIEDERLANDE** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Koninklijke KPN NV | 16.063 | 49 | 0,09 |
| VEON Ltd. ADR | 7.104 | 20 | 0,04 |
| | | 69 | 0,13 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Heineken Holding NV | 327 | 34 | 0,07 |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV | 4.102 | 92 | 0,18 |
| | | 126 | 0,25 |
| **ENERGIE** | | | |
| Fugro NV (a) | 962 | 9 | 0,02 |
| Royal Dutch Shell PLC 'A' | 10.464 | 341 | 0,67 |
| | | 350 | 0,69 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Aegon NV | 7.407 | 37 | 0,07 |
| ASR Nederland NV | 334 | 14 | 0,03 |
| ING Groep NV | 4.766 | 55 | 0,10 |
| NN Group NV | 625 | 25 | 0,05 |
| | | 131 | 0,25 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Koninklijke Philips NV | 2.175 | 95 | 0,18 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Boskalis Westminster | 385 | 9 | 0,02 |
| Signify NV | 2.227 | 66 | 0,13 |
| Wolters Kluwer NV | 336 | 24 | 0,04 |
| | | 99 | 0,19 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Global Developed Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Akzo Nobel NV | 328 | $ 31 | 0,06 |
| Koninklijke DSM NV | 104 | 13 | 0,02 |
| | | 44 | 0,08 |
| Summe Niederlande | | 914 | 1,77 |
| **NEUSEELAND** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Spark New Zealand Ltd. | 4.092 | 11 | 0,02 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Fletcher Building Ltd. | 2.956 | 10 | 0,02 |
| Summe Neuseeland | | 21 | 0,04 |
| **NORWEGEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telenor ASA | 1.573 | 34 | 0,06 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Marine Harvest ASA | 950 | 22 | 0,04 |
| **ENERGIE** | | | |
| Equinor ASA | 5.439 | 108 | 0,21 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| DNB ASA | 700 | 13 | 0,03 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Yara International ASA | 748 | 36 | 0,07 |
| Summe Norwegen | | 213 | 0,41 |
| **PORTUGAL** | | | |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| EDP - Energias de Portugal S.A. | 17.521 | 67 | 0,13 |
| **SINGAPUR** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Singapore Telecommunications Ltd. | 6.300 | 16 | 0,03 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| DBS Group Holdings Ltd. | 2.800 | 54 | 0,11 |
| Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. | 3.400 | 28 | 0,05 |
| United Overseas Bank Ltd. | 1.900 | 37 | 0,07 |
| | | 119 | 0,23 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ComfortDelGro Corp. Ltd. | 14.300 | 28 | 0,05 |
| Keppel Corp. Ltd. | 7.100 | 35 | 0,07 |
| Singapore Airlines Ltd. | 2.300 | 16 | 0,03 |
| | | 79 | 0,15 |
| Summe Singapur | | 214 | 0,41 |
| **SÜDAFRIKA** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Steinhoff International Holdings NV 'H' | 75.768 | 7 | 0,01 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Investec PLC | 1.575 | 10 | 0,02 |
| Summe Südafrika | | 17 | 0,03 |
| **SPANIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telefonica S.A. | 32.188 | 265 | 0,51 |
| **ENERGIE** | | | |
| Acciona S.A. | 324 | 35 | 0,07 |
| Repsol S.A. | 3.974 | 62 | 0,12 |
| | | 97 | 0,19 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. | 16.223 | $ 91 | 0,18 |
| Banco de Sabadell S.A. | 22.211 | 23 | 0,04 |
| Banco Santander S.A. | 77.353 | 359 | 0,70 |
| | | 473 | 0,92 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. | 1.944 | 78 | 0,15 |
| Ferrovial S.A. | 944 | 24 | 0,05 |
| | | 102 | 0,20 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Endesa S.A. | 3.361 | 87 | 0,17 |
| Iberdrola S.A. | 17.923 | 179 | 0,34 |
| Naturgy Energy Group S.A. | 2.358 | 65 | 0,12 |
| | | 331 | 0,63 |
| Summe Spanien | | 1.268 | 2,45 |
| **SCHWEDEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Tele2 AB 'B' | 1.286 | 19 | 0,04 |
| Telia Co. AB | 12.720 | 56 | 0,11 |
| | | 75 | 0,15 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Hennes & Mauritz AB 'B' | 2.498 | 44 | 0,09 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Swedish Match AB | 264 | 11 | 0,02 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | 4.087 | 38 | 0,07 |
| Svenska Handelsbanken AB 'A' | 2.749 | 27 | 0,05 |
| Swedbank AB 'A' | 2.172 | 33 | 0,07 |
| | | 98 | 0,19 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Getinge AB 'B' | 2.246 | 36 | 0,07 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Sandvik AB | 632 | 12 | 0,03 |
| Skanska AB 'B' | 548 | 10 | 0,02 |
| SKF AB 'B' | 677 | 12 | 0,02 |
| | | 34 | 0,07 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | 13.852 | 132 | 0,24 |
| Summe Schweden | | 430 | 0,83 |
| **SCHWEIZ** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Swisscom AG | 74 | 37 | 0,07 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Cie Financiere Richemont S.A. | 356 | 30 | 0,06 |
| Garmin Ltd. | 218 | 17 | 0,03 |
| Garrett Motion, Inc. (a) | 33 | 1 | 0,00 |
| Swatch Group AG | 33 | 10 | 0,02 |
| | | 58 | 0,11 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Nestle S.A. | 3.514 | 364 | 0,71 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Credit Suisse Group AG | 3.471 | 42 | 0,08 |
| Swiss Life Holding AG | 193 | $ 96 | 0,19 |
| Swiss Re AG | 1.842 | 187 | 0,36 |
| UBS Group AG | 8.829 | 105 | 0,20 |
| Zurich Insurance Group AG | 621 | 216 | 0,42 |
| | | 646 | 1,25 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Alcon, Inc. (a) | 645 | 40 | 0,08 |
| Novartis AG | 3.228 | 295 | 0,57 |
| Roche Holding AG | 921 | 259 | 0,50 |
| | | 594 | 1,15 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ABB Ltd. | 3.703 | 75 | 0,15 |
| Adecco Group AG | 702 | 42 | 0,08 |
| Kuehne + Nagel International AG | 72 | 11 | 0,02 |
| | | 128 | 0,25 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| TE Connectivity Ltd. | 94 | 9 | 0,02 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| LafargeHolcim Ltd. | 998 | 49 | 0,09 |
| Summe Schweiz | | 1.885 | 3,65 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| BT Group PLC | 25.805 | 64 | 0,12 |
| ITV PLC | 6.497 | 9 | 0,02 |
| Pearson PLC | 4.199 | 44 | 0,09 |
| Vodafone Group PLC | 71.730 | 118 | 0,23 |
| WPP PLC | 6.749 | 85 | 0,16 |
| | | 320 | 0,62 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Berkeley Group Holdings PLC | 367 | 17 | 0,03 |
| Burberry Group PLC | 445 | 11 | 0,03 |
| Compass Group PLC | 2.484 | 60 | 0,12 |
| Fiat Chrysler Automobiles NV | 5.256 | 73 | 0,14 |
| Greene King PLC | 1.932 | 15 | 0,03 |
| Kingfisher PLC | 13.401 | 37 | 0,07 |
| Marks & Spencer Group PLC | 18.402 | 49 | 0,09 |
| Next PLC | 617 | 43 | 0,08 |
| Whitbread PLC | 156 | 9 | 0,02 |
| William Hill PLC | 4.390 | 9 | 0,02 |
| | | 323 | 0,63 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| British American Tobacco PLC | 1.463 | 51 | 0,10 |
| Diageo PLC | 1.932 | 83 | 0,16 |
| Imperial Brands PLC | 3.760 | 88 | 0,17 |
| J Sainsbury PLC | 14.768 | 37 | 0,07 |
| Reckitt Benckiser Group PLC | 910 | 72 | 0,14 |
| Tesco PLC | 3.455 | 10 | 0,02 |
| Unilever NV | 1.267 | 77 | 0,15 |
| Unilever PLC | 895 | 56 | 0,11 |
| WM Morrison Supermarkets PLC | 10.010 | 26 | 0,05 |
| | | 500 | 0,97 |
| **ENERGIE** | | | |
| BP PLC | 55.055 | 384 | 0,74 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| 3i Group PLC | 1.008 | 14 | 0,03 |
| Aviva PLC | 13.496 | 72 | 0,14 |
| Barclays PLC | 75.551 | 144 | 0,28 |
| Direct Line Insurance Group PLC | 12.359 | 52 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| HSBC Holdings PLC | 45.207 | $ 378 | 0,72 |
| Legal & General Group PLC | 6.861 | 24 | 0,05 |
| Lloyds Banking Group PLC | 180.315 | 130 | 0,25 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC | 3.400 | 9 | 0,02 |
| Standard Chartered PLC | 10.458 | 95 | 0,18 |
| | | 918 | 1,77 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| AstraZeneca PLC | 3.013 | 247 | 0,48 |
| GlaxoSmithKline PLC | 16.265 | 327 | 0,63 |
| | | 574 | 1,11 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| BAE Systems PLC | 11.547 | 73 | 0,14 |
| Capita PLC (a) | 10.395 | 14 | 0,03 |
| CNH Industrial NV | 1.115 | 11 | 0,02 |
| easyJet PLC | 837 | 10 | 0,02 |
| Experian PLC | 545 | 17 | 0,03 |
| Ferguson PLC | 759 | 54 | 0,11 |
| International Consolidated Airlines Group S.A. | 4.130 | 25 | 0,05 |
| Meggitt PLC | 1.578 | 11 | 0,02 |
| RELX PLC | 482 | 12 | 0,02 |
| Rolls-Royce Holdings PLC | 3.807 | 41 | 0,08 |
| Royal Mail PLC | 15.350 | 41 | 0,08 |
| | | 309 | 0,60 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Anglo American PLC | 393 | 11 | 0,02 |
| BHP Group PLC | 3.852 | 99 | 0,19 |
| Linde PLC | 143 | 29 | 0,06 |
| Rio Tinto Ltd. | 694 | 51 | 0,10 |
| Rio Tinto PLC | 2.411 | 149 | 0,29 |
| | | 339 | 0,66 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Centrica PLC | 55.109 | 62 | 0,12 |
| National Grid PLC | 12.315 | 131 | 0,25 |
| Severn Trent PLC | 372 | 10 | 0,02 |
| SSE PLC | 2.997 | 43 | 0,08 |
| United Utilities Group PLC | 1.833 | 18 | 0,04 |
| | | 264 | 0,51 |
| Summe Großbritannien | | 3.931 | 7,61 |
| **USA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Alphabet, Inc. 'A' (a) | 5 | 5 | 0,01 |
| AT&T, Inc. | 13.034 | 437 | 0,85 |
| CBS Corp. NVDR 'B' | 1.869 | 93 | 0,18 |
| CenturyLink, Inc. | 8.391 | 99 | 0,19 |
| Comcast Corp. 'A' | 4.217 | 178 | 0,34 |
| Discovery, Inc. 'A' (a) | 887 | 27 | 0,05 |
| Fox Corp. 'A' | 982 | 36 | 0,07 |
| Frontier Communications Corp. (a) | 4.446 | 8 | 0,02 |
| Interpublic Group of Cos., Inc. | 798 | 18 | 0,03 |
| Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' (a) | 1.727 | 66 | 0,13 |
| Omnicom Group, Inc. | 599 | 49 | 0,10 |
| Sprint Corp. (a) | 1.673 | 11 | 0,02 |
| T-Mobile US, Inc. (a) | 145 | 11 | 0,02 |
| Telephone & Data Systems, Inc. | 841 | 26 | 0,05 |
| Tribune Media Co. 'A' | 702 | 32 | 0,06 |
| Verizon Communications, Inc. | 8.671 | 495 | 0,96 |
| Viacom, Inc. 'B' | 4.784 | 143 | 0,28 |
| Walt Disney Co. | 2.268 | 317 | 0,61 |
| | | 2.051 | 3,97 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Abercrombie & Fitch Co. 'A' | 2.084 | $ 33 | 0,06 |
| Adient PLC | 418 | 10 | 0,02 |
| American Eagle Outfitters, Inc. | 430 | 7 | 0,01 |
| Ascena Retail Group, Inc. (a) | 3.229 | 2 | 0,00 |
| Bed Bath & Beyond, Inc. | 6.417 | 75 | 0,15 |
| Best Buy Co., Inc. | 786 | 55 | 0,11 |
| Big Lots, Inc. | 895 | 26 | 0,05 |
| Carnival Corp. | 401 | 19 | 0,04 |
| Dick's Sporting Goods, Inc. | 501 | 17 | 0,03 |
| Dillard's, Inc. 'A' | 534 | 33 | 0,06 |
| Dollar General Corp. | 376 | 51 | 0,10 |
| eBay, Inc. | 837 | 33 | 0,06 |
| Foot Locker, Inc. | 486 | 20 | 0,04 |
| Ford Motor Co. | 13.218 | 135 | 0,26 |
| Fossil Group, Inc. (a) | 2.011 | 23 | 0,04 |
| GameStop Corp. 'A' | 4.261 | 23 | 0,04 |
| Gap, Inc. | 1.867 | 34 | 0,07 |
| General Motors Co. | 4.618 | 178 | 0,34 |
| Genuine Parts Co. | 94 | 10 | 0,02 |
| Goodyear Tire & Rubber Co. | 1.370 | 21 | 0,04 |
| Home Depot, Inc. | 1.094 | 227 | 0,44 |
| JC Penney Co., Inc. (a) | 8.339 | 9 | 0,02 |
| Kohl's Corp. | 1.731 | 82 | 0,16 |
| Kontoor Brands, Inc. (a) | 73 | 2 | 0,00 |
| L Brands, Inc. | 1.557 | 41 | 0,08 |
| Las Vegas Sands Corp. | 195 | 12 | 0,02 |
| Lowe's Cos., Inc. | 1.209 | 122 | 0,24 |
| Macy's, Inc. | 3.365 | 72 | 0,14 |
| Mattel, Inc. (a) | 2.525 | 28 | 0,05 |
| McDonald's Corp. | 937 | 195 | 0,38 |
| NIKE, Inc. 'B' | 688 | 58 | 0,11 |
| Nordstrom, Inc. | 1.203 | 38 | 0,07 |
| O'Reilly Automotive, Inc. (a) | 96 | 35 | 0,07 |
| Office Depot, Inc. | 8.052 | 17 | 0,03 |
| PulteGroup, Inc. | 316 | 10 | 0,02 |
| Qurate Retail, Inc. (a) | 2.063 | 26 | 0,05 |
| Ralph Lauren Corp. | 351 | 40 | 0,08 |
| Sally Beauty Holdings, Inc. (a) | 1.885 | 25 | 0,05 |
| Signet Jewelers Ltd. | 812 | 14 | 0,03 |
| Tapestry, Inc. | 435 | 14 | 0,03 |
| Target Corp. | 2.729 | 236 | 0,46 |
| TJX Cos., Inc. | 1.316 | 70 | 0,14 |
| Tupperware Brands Corp. | 436 | 8 | 0,02 |
| Urban Outfitters, Inc. (a) | 313 | 7 | 0,01 |
| VF Corp. | 512 | 45 | 0,09 |
| Visteon Corp. (a) | 487 | 29 | 0,06 |
| Wendy's Co. | 646 | 13 | 0,03 |
| Whirlpool Corp. | 176 | 25 | 0,05 |
| Wyndham Destinations, Inc. | 491 | 22 | 0,04 |
| Yum! Brands, Inc. | 628 | 69 | 0,13 |
| | | 2.396 | 4,64 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Altria Group, Inc. | 723 | 34 | 0,06 |
| Archer-Daniels-Midland Co. | 1.790 | 73 | 0,14 |
| Bunge Ltd. | 496 | 28 | 0,05 |
| Coca-Cola Co. | 3.634 | 185 | 0,36 |
| Colgate-Palmolive Co. | 573 | 41 | 0,08 |
| Costco Wholesale Corp. | 190 | 50 | 0,10 |
| General Mills, Inc. | 1.274 | 67 | 0,13 |
| Herbalife Nutrition Ltd. (a) | 757 | 32 | 0,06 |
| JM Smucker Co. | 81 | 9 | 0,02 |
| Kimberly-Clark Corp. | 222 | 30 | 0,06 |
| Kraft Heinz Co. | 315 | 10 | 0,02 |
| Kroger Co. | 6.869 | 149 | 0,29 |
| Mondelez International, Inc. 'A' | 2.398 | 129 | 0,25 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| PepsiCo, Inc. | 1.839 | $ 241 | 0,47 |
| Philip Morris International, Inc. | 1.890 | 148 | 0,29 |
| Procter & Gamble Co. | 3.169 | 348 | 0,67 |
| Rite Aid Corp. (a) | 1.071 | 9 | 0,02 |
| Spectrum Brands Holdings, Inc. | 205 | 11 | 0,02 |
| Sysco Corp. | 499 | 35 | 0,07 |
| U.S. Foods Holding Corp. (a) | 1.196 | 43 | 0,08 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 4.073 | 450 | 0,87 |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | 525 | 29 | 0,05 |
| | | 2.151 | 4,16 |
| **ENERGIE** | | | |
| Anadarko Petroleum Corp. | 211 | 15 | 0,03 |
| Apache Corp. | 945 | 27 | 0,05 |
| Chesapeake Energy Corp. (a) | 13.326 | 26 | 0,05 |
| Chevron Corp. | 2.372 | 295 | 0,57 |
| ConocoPhillips | 2.011 | 123 | 0,24 |
| Diamond Offshore Drilling, Inc. (a) | 1.648 | 15 | 0,03 |
| Exxon Mobil Corp. | 6.990 | 536 | 1,04 |
| Hess Corp. | 1.135 | 72 | 0,14 |
| HollyFrontier Corp. | 609 | 28 | 0,05 |
| Kinder Morgan, Inc. | 5.388 | 112 | 0,22 |
| Marathon Oil Corp. | 3.071 | 44 | 0,09 |
| Marathon Petroleum Corp. | 985 | 55 | 0,11 |
| Murphy Oil Corp. | 1.355 | 33 | 0,06 |
| Nabors Industries Ltd. | 7.230 | 21 | 0,04 |
| National Oilwell Varco, Inc. | 1.463 | 33 | 0,06 |
| Occidental Petroleum Corp. | 1.233 | 62 | 0,12 |
| Oceaneering International, Inc. (a) | 1.070 | 22 | 0,04 |
| Phillips 66 | 815 | 76 | 0,15 |
| Transocean Ltd. | 7.716 | 49 | 0,09 |
| Valero Energy Corp. | 1.244 | 106 | 0,21 |
| Whiting Petroleum Corp. (a) | 299 | 6 | 0,01 |
| | | 1.756 | 3,40 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Aflac, Inc. | 1.190 | 65 | 0,13 |
| Allstate Corp. | 780 | 79 | 0,15 |
| Ally Financial, Inc. | 5.995 | 186 | 0,36 |
| American Express Co. | 1.306 | 161 | 0,31 |
| American International Group, Inc. | 9.954 | 530 | 1,03 |
| Ameriprise Financial, Inc. | 339 | 49 | 0,09 |
| Assurant, Inc. | 269 | 29 | 0,06 |
| Bank of America Corp. | 6.917 | 201 | 0,39 |
| Bank of New York Mellon Corp. | 1.124 | 50 | 0,10 |
| BB&T Corp. | 881 | 43 | 0,08 |
| Berkshire Hathaway, Inc. 'B' (a) | 1.079 | 230 | 0,44 |
| BlackRock, Inc. | 40 | 19 | 0,04 |
| Brighthouse Financial, Inc. (a) | 490 | 18 | 0,03 |
| Capital One Financial Corp. | 2.210 | 201 | 0,39 |
| CIT Group, Inc. | 829 | 44 | 0,08 |
| Citigroup, Inc. | 4.219 | 295 | 0,57 |
| Citizens Financial Group, Inc. | 278 | 10 | 0,02 |
| CNO Financial Group, Inc. | 1.134 | 19 | 0,04 |
| Discover Financial Services | 1.805 | 140 | 0,27 |
| Fifth Third Bancorp | 1.607 | 45 | 0,09 |
| Franklin Resources, Inc. | 1.479 | 52 | 0,10 |
| Genworth Financial, Inc. 'A' (a) | 6.496 | 24 | 0,05 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 383 | 78 | 0,15 |
| Hartford Financial Services Group, Inc. | 811 | 45 | 0,09 |
| Invesco Ltd. | 1.955 | 40 | 0,08 |
| JPMorgan Chase & Co. | 3.231 | 361 | 0,70 |
| Legg Mason, Inc. | 1.546 | 59 | 0,11 |
| Lincoln National Corp. | 234 | 15 | 0,03 |
| Loews Corp. | 650 | 36 | 0,07 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Global Developed Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| MetLife, Inc. | 1.012 | $ 50 | 0,10 |
| Navient Corp. | 4.522 | 62 | 0,12 |
| New York Community Bancorp, Inc. | 2.627 | 26 | 0,05 |
| OneMain Holdings, Inc. | 597 | 20 | 0,04 |
| PNC Financial Services Group, Inc. | 410 | 56 | 0,11 |
| Prudential Financial, Inc. | 345 | 35 | 0,07 |
| Regions Financial Corp. | 841 | 13 | 0,02 |
| Santander Consumer USA Holdings, Inc. | 2.016 | 48 | 0,09 |
| State Street Corp. | 572 | 32 | 0,06 |
| SunTrust Banks, Inc. | 226 | 14 | 0,03 |
| Synchrony Financial | 774 | 27 | 0,05 |
| Travelers Cos., Inc. | 1.414 | 211 | 0,41 |
| U.S. Bancorp | 2.428 | 127 | 0,25 |
| Voya Financial, Inc. | 1.718 | 95 | 0,18 |
| Wells Fargo & Co. | 7.189 | 340 | 0,66 |
| White Mountains Insurance Group Ltd. | 35 | 36 | 0,07 |
| | | 4.316 | 8,36 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Abbott Laboratories | 735 | 62 | 0,12 |
| AbbVie, Inc. | 872 | 63 | 0,12 |
| Allergan PLC | 695 | 116 | 0,23 |
| Amgen, Inc. | 589 | 109 | 0,21 |
| Anthem, Inc. | 475 | 134 | 0,26 |
| Bausch Health Cos., Inc. (a) | 5.338 | 135 | 0,26 |
| Bristol-Myers Squibb Co. | 829 | 38 | 0,07 |
| Brookdale Senior Living, Inc. (a) | 3.956 | 28 | 0,05 |
| Cardinal Health, Inc. | 960 | 45 | 0,09 |
| Celgene Corp. (a) | 269 | 25 | 0,05 |
| Cigna Corp. | 458 | 72 | 0,14 |
| Community Health Systems, Inc. (a) | 2.590 | 7 | 0,01 |
| CVS Health Corp. | 4.708 | 257 | 0,50 |
| DaVita, Inc. (a) | 428 | 24 | 0,05 |
| Eli Lilly & Co. | 478 | 53 | 0,10 |
| Gilead Sciences, Inc. | 3.824 | 258 | 0,50 |
| HCA Healthcare, Inc. | 1.658 | 224 | 0,43 |
| Humana, Inc. | 132 | 35 | 0,07 |
| Johnson & Johnson | 2.364 | 329 | 0,64 |
| Mallinckrodt PLC (a) | 2.784 | 26 | 0,05 |
| McKesson Corp. | 276 | 37 | 0,07 |
| MEDNAX, Inc. (a) | 294 | 7 | 0,01 |
| Merck & Co., Inc. | 5.206 | 437 | 0,85 |
| Patterson Cos., Inc. | 1.088 | 25 | 0,05 |
| Pfizer, Inc. | 13.657 | 592 | 1,15 |
| Quest Diagnostics, Inc. | 266 | 27 | 0,05 |
| Tenet Healthcare Corp. (a) | 2.756 | 57 | 0,11 |
| United Therapeutics Corp. (a) | 170 | 13 | 0,03 |
| UnitedHealth Group, Inc. | 530 | 129 | 0,25 |
| Universal Health Services, Inc. 'B' | 247 | 32 | 0,06 |
| | | 3.396 | 6,58 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| 3M Co. | 506 | 88 | 0,17 |
| AGCO Corp. | 133 | 10 | 0,02 |
| American Airlines Group, Inc. | 4.050 | 132 | 0,26 |
| Arcosa, Inc. | 221 | 8 | 0,02 |
| Avis Budget Group, Inc. (a) | 2.811 | 99 | 0,19 |
| Caterpillar, Inc. | 194 | 26 | 0,05 |
| CSX Corp. | 579 | 45 | 0,09 |
| Cummins, Inc. | 184 | 32 | 0,06 |
| Deere & Co. | 458 | 76 | 0,15 |
| Delta Air Lines, Inc. | 498 | 28 | 0,05 |
| Eaton Corp. PLC | 488 | 41 | 0,08 |
| Emerson Electric Co. | 1.139 | $ 76 | 0,15 |
| FedEx Corp. | 235 | 39 | 0,07 |
| Flowserve Corp. | 479 | 25 | 0,05 |
| Fluor Corp. | 494 | 17 | 0,03 |
| General Dynamics Corp. | 151 | 27 | 0,05 |
| General Electric Co. | 53.760 | 564 | 1,09 |
| Hertz Global Holdings, Inc. (a) | 4.172 | 67 | 0,13 |
| Honeywell International, Inc. | 393 | 69 | 0,13 |
| Illinois Tool Works, Inc. | 371 | 56 | 0,11 |
| JetBlue Airways Corp. (a) | 681 | 13 | 0,02 |
| ManpowerGroup, Inc. | 419 | 40 | 0,08 |
| Neilsen Holdings PLC | 851 | 19 | 0,04 |
| Norfolk Southern Corp. | 321 | 64 | 0,12 |
| Northrop Grumman Corp. | 210 | 68 | 0,13 |
| Pitney Bowes, Inc. | 5.359 | 23 | 0,04 |
| Raytheon Co. | 231 | 40 | 0,08 |
| Resideo Technologies, Inc. (a) | 66 | 1 | 0,00 |
| Robert Half International, Inc. | 151 | 9 | 0,02 |
| Ryder System, Inc. | 601 | 35 | 0,07 |
| Trinity Industries, Inc. | 440 | 9 | 0,02 |
| Union Pacific Corp. | 1.089 | 184 | 0,36 |
| United Continental Holdings, Inc. (a) | 460 | 40 | 0,08 |
| United Technologies Corp. | 1.100 | 143 | 0,28 |
| Waste Management, Inc. | 174 | 20 | 0,04 |
| WESCO International, Inc. (a) | 231 | 12 | 0,02 |
| WW Grainger, Inc. | 152 | 41 | 0,08 |
| | | 2.286 | 4,43 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Amdocs Ltd. | 172 | 11 | 0,02 |
| Apple, Inc. | 4.596 | 910 | 1,75 |
| Applied Materials, Inc. | 500 | 22 | 0,04 |
| Arrow Electronics, Inc. (a) | 467 | 33 | 0,06 |
| Avaya Holdings Corp. (a) | 1.677 | 20 | 0,04 |
| Avnet, Inc. | 911 | 41 | 0,08 |
| Booz Allen Hamilton Holding Corp. | 797 | 53 | 0,10 |
| Cisco Systems, Inc. | 4.128 | 226 | 0,44 |
| Conduent, Inc. (a) | 880 | 8 | 0,02 |
| Corning, Inc. | 5.255 | 175 | 0,34 |
| DXC Technology Co. | 345 | 19 | 0,04 |
| F5 Networks, Inc. (a) | 83 | 12 | 0,02 |
| Flex Ltd. (a) | 1.243 | 12 | 0,02 |
| Hewlett Packard Enterprise Co. | 8.267 | 124 | 0,24 |
| HP, Inc. | 1.558 | 32 | 0,06 |
| Intel Corp. | 6.602 | 316 | 0,61 |
| International Business Machines Corp. | 4.632 | 639 | 1,24 |
| Jabil, Inc. | 955 | 30 | 0,06 |
| Juniper Networks, Inc. | 1.858 | 49 | 0,10 |
| KLA-Tencor Corp. | 200 | 24 | 0,05 |
| Microsoft Corp. | 3.444 | 461 | 0,89 |
| Motorola Solutions, Inc. | 555 | 92 | 0,18 |
| NetApp, Inc. | 985 | 61 | 0,12 |
| Oracle Corp. | 3.330 | 190 | 0,37 |
| QUALCOMM, Inc. | 4.831 | 367 | 0,71 |
| Seagate Technology PLC | 3.223 | 152 | 0,29 |
| Symantec Corp. | 1.697 | 37 | 0,07 |
| Teradata Corp. (a) | 884 | 32 | 0,06 |
| Texas Instruments, Inc. | 498 | 57 | 0,11 |
| Western Digital Corp. | 201 | 10 | 0,02 |
| Western Union Co. | 2.153 | 43 | 0,08 |
| Xerox Corp. | 1.885 | 67 | 0,13 |
| | | 4.325 | 8,36 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Alcoa Corp. (a) | 310 | $ 7 | 0,01 |
| CF Industries Holdings, Inc. | 374 | 17 | 0,03 |
| Domtar Corp. | 532 | 24 | 0,05 |
| International Paper Co. | 1.028 | 45 | 0,09 |
| LyondellBasell Industries NV 'A' | 1.975 | 170 | 0,33 |
| Mosaic Co. | 3.235 | 81 | 0,16 |
| PPG Industries, Inc. | 362 | 42 | 0,08 |
| Sealed Air Corp. | 601 | 26 | 0,05 |
| | | 412 | 0,80 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| AES Corp. | 6.995 | 117 | 0,23 |
| Ameren Corp. | 847 | 64 | 0,12 |
| American Electric Power Co., Inc. | 1.290 | 114 | 0,22 |
| CenterPoint Energy, Inc. | 1.156 | 33 | 0,06 |
| CMS Energy Corp. | 409 | 24 | 0,05 |
| Consolidated Edison, Inc. | 1.089 | 95 | 0,18 |
| DTE Energy Co. | 82 | 10 | 0,02 |
| Duke Energy Corp. | 1.992 | 176 | 0,34 |
| Edison International | 1.043 | 70 | 0,14 |
| Entergy Corp. | 1.077 | 111 | 0,22 |
| Eversource Energy | 673 | 51 | 0,10 |
| Exelon Corp. | 3.158 | 151 | 0,29 |
| FirstEnergy Corp. | 2.026 | 87 | 0,17 |
| MDU Resources Group, Inc. | 822 | 21 | 0,04 |
| NextEra Energy, Inc. | 308 | 63 | 0,12 |
| Pinnacle West Capital Corp. | 297 | 28 | 0,05 |
| PPL Corp. | 2.212 | 69 | 0,13 |
| Public Service Enterprise Group, Inc. | 1.220 | 72 | 0,14 |
| Southern Co. | 879 | 49 | 0,09 |
| UGI Corp. | 183 | 10 | 0,02 |
| Vistra Energy Corp. | 2.437 | 55 | 0,11 |
| WEC Energy Group, Inc. | 129 | 11 | 0,02 |
| Xcel Energy, Inc. | 1.032 | 61 | 0,12 |
| | | 1.542 | 2,98 |
| Summe USA | | 24.631 | 47,68 |
| Summe Stammaktien | | 50.716 | 98,19 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Schaeffler AG | 1.356 | 10 | 0,02 |
| Volkswagen AG | 1.152 | 194 | 0,37 |
| | | 204 | 0,39 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | |
| Annaly Capital Management, Inc. | 890 | 8 | 0,02 |
| British Land Co. PLC | 1.808 | 12 | 0,02 |
| CoreCivic, Inc. | 1.449 | 30 | 0,06 |
| Equity Residential | 137 | 10 | 0,02 |
| H&R Real Estate Investment Trust | 1.574 | 28 | 0,05 |
| HCP, Inc. | 1.056 | 34 | 0,07 |
| Hospitality Properties Trust | 703 | 18 | 0,03 |
| Host Hotels & Resorts, Inc. | 654 | 12 | 0,02 |
| Intu Properties PLC | 6.318 | 6 | 0,01 |
| Kimco Realty Corp. | 556 | 10 | 0,02 |
| Land Securities Group PLC | 2.250 | 24 | 0,05 |
| Mirvac Group | 4.668 | 10 | 0,02 |
| RioCan Real Estate Investment Trust | 1.086 | 22 | 0,04 |
| Senior Housing Properties Trust | 1.627 | 13 | 0,03 |
| Stockland | 7.883 | 23 | 0,04 |
| Ventas, Inc. | 597 | 41 | 0,08 |
| Welltower, Inc. | 533 | 44 | 0,09 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | 345 | 0,67 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **RECHTE** | | | |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. - Exp. 11.07.2019 | 1.944 | $ 3 | 0,01 |
| Hertz Global Holdings, Inc. - Exp. 12.07.2019 | 4.172 | 8 | 0,02 |
| Repsol S.A. - Exp. 09.07.2019 | 3.974 | 2 | 0,00 |
| | | 13 | 0,03 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/ Geregelter Markt** | | **$ 51.278** | **99,28** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 51.278** | **99,28** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 370** | **0,72** |
| **Nettovermögen** | | **$ 51.648** | **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.**

**Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 27.834 | $ 23.444 | $ 0 | $ 51.278 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 17.444 | $ 14.164 | $ 0 | $ 31.608 |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 99,28 | 98,96 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Stammaktien | | |
| Australien | 2,87 | 2,43 |
| Österreich | 0,17 | 0,20 |
| Belgien | 0,34 | 0,29 |
| Kanada | 3,92 | 3,44 |
| Dänemark | 0,26 | 0,26 |
| Finnland | 0,28 | 0,26 |
| Frankreich | 5,91 | 5,60 |
| Deutschland | 4,23 | 3,93 |
| Hongkong | 0,62 | 0,77 |
| Irland | 0,43 | 0,40 |
| Israel | 0,33 | 0,36 |
| Italien | 1,90 | 1,57 |
| Japan | 11,84 | 11,35 |
| Luxemburg | 0,08 | 0,08 |
| Macau | 0,00 | 0,02 |
| Niederlande | 1,77 | 1,73 |
| Neuseeland | 0,04 | 0,03 |
| Norwegen | 0,41 | 0,43 |
| Portugal | 0,13 | 0,13 |
| Singapur | 0,41 | 0,53 |
| Südafrika | 0,03 | 0,09 |
| Spanien | 2,45 | 2,17 |
| Schweden | 0,83 | 0,73 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE Global Developed Fund
**(Forts.)**

30. Juni 2019

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Schweiz | 3,65 | 3,34 |
| Großbritannien | 7,61 | 7,91 |
| Vereinigte Staaten | 47,68 | 49,95 |
| Vorzugswertpapiere | 0,39 | 0,38 |
| Real Estate Investment Trusts | 0,67 | 0,58 |
| Bezugsrechte | 0,03 | 0,00 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,72 | 1,04 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **USA** | | | |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Iowa Tobacco Settlement Authority Revenue Bonds, Series 2005** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.06.2023 | 15 | $ 15 | 0,06 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 2.800 | 2.862 | 11,74 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 1.400 | 1.447 | 5,94 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2049 | 100 | 104 | 0,43 |
| | | 4.413 | 18,11 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049 | 400 | 439 | 1,80 |
| 4,375 % fällig am 15.05.2040 | 500 | 666 | 2,74 |
| 4,625 % fällig am 15.02.2040 | 300 | 412 | 1,69 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2021 | 323 | 321 | 1,32 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 | 1.366 | 1.355 | 5,56 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 | 1.000 | $ 997 | 4,09 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 65 | 66 | 0,27 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | 202 | 213 | 0,87 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | 277 | 291 | 1,19 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | 1.200 | 1.221 | 5,01 |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 | 2.800 | 2.953 | 12,11 |
| | | 8.934 | 36,65 |
| Summe USA | | 13.362 | 54,82 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (e)** | | | |
| | | 4.726 | 19,39 |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 2,243 % fällig am 16.08.2019 (a)(b) | 500 | 498 | 2,04 |
| 2,254 % fällig am 21.08.2019 (a)(b) | 5.200 | 5.184 | 21,27 |
| 2,266 % fällig am 16.07.2019 (a)(b) | 400 | 400 | 1,64 |
| 2,294 % fällig am 07.08.2019 (a)(b) | 2.700 | 2.694 | 11,05 |
| 2,300 % fällig am 07.08.2019 (a)(b) | 100 | 100 | 0,41 |
| 2,336 % fällig am 03.07.2019 (a)(b) | 600 | 600 | 2,46 |
| 2,359 % fällig am 31.07.2019 (a)(b) | 400 | $ 399 | 1,64 |
| 2,443 % fällig am 09.07.2019 (a)(b) | 100 | 100 | 0,41 |
| | | 9.975 | 40,92 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 14.701 | 60,31 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | 3.011 | 30 | 0,13 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 28.093** | **115,26** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2020 | 40 | $ (68) | (0,28) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 129,750 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 4 | 0 | 0,00 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 10 | (17) | (0,07) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 17 | (19) | (0,08) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 35 | 84 | 0,34 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 15 | (79) | (0,32) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 1 | 9 | 0,04 |
| | | | | $ (90) | (0,37) |

[1] Future-Style-Option.

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | $ 110,000 | 23.08.2019 | 10 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,500 | 23.08.2019 | 7 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 114,000 | 23.08.2019 | 11 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 114,500 | 23.08.2019 | 3 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 115,000 | 23.08.2019 | 7 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 195,000 | 23.08.2019 | 15 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (90)** | **(0,37)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 15.500 | $ 23 | 0,10 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 21.06.2024 | 7.100 $ | $ 197 | 0,81 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 21.12.2026 | 600 | (3) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 20.06.2025 | 6.100 | (436) | (1,80) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,240 | 23.06.2022 | 6.900 | (42) | (0,17) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 15.06.2026 | 1.100 | 34 | 0,14 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,700 | 14.12.2023 | 2.900 | 150 | 0,61 |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,900 | 05.03.2021 | 2.500 | 33 | 0,13 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,928 | 31.05.2025 | 1.200 | (77) | (0,32) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,930 | 05.03.2022 | 1.800 | (24) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,985 | 05.06.2029 | 2.900 | (245) | (1,00) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 900 | (3) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 15.02.2036 | 2.000 | 258 | 1,06 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 15.05.2044 | 1.500 | (242) | (0,99) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2049 | 600 | (72) | (0,29) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,093 | 14.12.2048 | 100 | (19) | (0,08) |
| | | | | | $ (491) | (2,02) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (468)** | **(1,92)** |

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF WERTPAPIERE**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 70,000 $ | 08.07.2019 | 4.000 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 71,000 | 08.07.2019 | 900 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 0 | $ 0 | 0,00 |

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

**TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES**

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FBF | Erhalt | ERAEMLT Index | 171 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 475 | 06.08.2019 | $ 0 | $ 21 | $ 21 | 0,09 |
| JPM | Erhalt | ERAEMLT Index | 2.305 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 6.399 | 06.11.2019 | 0 | 285 | 285 | 1,17 |
| MEI | Erhalt | ERAEMLT Index | 5.920 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 16.166 | 12.09.2019 | 0 | 978 | 978 | 4,01 |
| | | | | | | | $ 0 | $ 1.284 | $ 1.284 | 5,27 |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CLP | 16.722 | $ | 25 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 11 | € | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | PEN | 640 | $ | 194 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 8 | BRL | 30 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 193 | PEN | 640 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 71 | TWD | 2.233 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 118 | RUB | 7.685 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 09/2019 | CNY | 2.154 | $ | 311 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 91 | KRW | 108.308 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 194 | PEN | 640 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € | 545 | $ | 610 | 0 | (11) | (11) | (0,05) |
| | 09/2019 | $ | 35 | TWD | 1.101 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | ARS | 152 | $ | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | AUD | 31 | | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 35 | | 26 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | CLP | 30.525 | | 43 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 07/2019 | ¥ | 85.400 | | 784 | 0 | (9) | (9) | (0,04) |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 07/2019 | $ | 112 | € | 100 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 61 | £ | 48 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 765 | ¥ | 83.000 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| | 08/2019 | PEN | 635 | $ | 189 | 0 | (4) | (4) | (0,02) |
| | 09/2019 | $ | 1 | CLP | 742 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| DUB | 07/2019 | COP | 138.029 | $ | 41 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| GLM | 07/2019 | $ | 25 | CLP | 17.510 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 184 | € | 165 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 188 | £ | 148 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | RUB | 13.228 | $ | 201 | 0 | (7) | (7) | (0,03) |
| | 09/2019 | $ | 64 | INR | 4.517 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 15 | ARS | 760 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 09/2019 | CNH | 5.388 | $ | 776 | 0 | (7) | (7) | (0,03) |
| | 09/2019 | IDR | 1.247.715 | | 85 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 09/2019 | KRW | 438.707 | | 369 | 0 | (11) | (11) | (0,05) |
| | 09/2019 | TWD | 4.293 | | 136 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 182 | CNH | 1.265 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 88 | IDR | 1.296.442 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 108 | INR | 7.667 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 71 | TWD | 2.254 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 11/2019 | TWD | 6.351 | $ | 203 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 11/2019 | $ | 843 | CNH | 5.711 | 0 | (13) | (13) | (0,05) |
| | 01/2021 | BRL | 70 | $ | 11 | 0 | (7) | (7) | (0,03) |
| IND | 09/2019 | INR | 25.107 | | 355 | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| | 09/2019 | KRW | 138.060 | | 116 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 09/2019 | THB | 923 | | 29 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 29 | THB | 922 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 29 | CLP | 20.843 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 230 | € | 203 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 26 | £ | 21 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | INR | 4.053 | $ | 57 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 918 | CNH | 6.368 | 8 | 0 | 8 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 300 | TWD | 9.472 | 7 | 0 | 7 | 0,03 |
| | 11/2019 | TWD | 4.606 | $ | 147 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| MSB | 07/2019 | BRL | 100 | | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | TWD | 2.233 | | 71 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 26 | BRL | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | | 71 | TWD | 2.233 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| MYI | 09/2019 | | 14 | HKD | 112 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| NGF | 11/2019 | CNH | 3.331 | $ | 476 | 0 | (8) | (8) | (0,03) |
| RBC | 07/2019 | $ | 18 | BRL | 70 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 13 | CLP | 8.893 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 43 | COP | 138.029 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | COP | 138.029 | $ | 43 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 228 | | 289 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 80 | RUB | 5.306 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| | 11/2019 | CNH | 2.380 | $ | 340 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| SOG | 09/2019 | $ | 399 | KRW | 472.683 | 10 | 0 | 10 | 0,04 |
| TOR | 08/2019 | | 3 | MXN | 64 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 42 | COP | 141.498 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| UAG | 07/2019 | | 149 | € | 131 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 253 | INR | 17.899 | 4 | 0 | 4 | 0,02 |
| | | | | | | $ 76 | $ (116) | $ (40) | (0,17) |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 1.244** | **5,10** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA**<br>5,000 % fällig am 01.07.2049 | $ 100 | $ (106) | (0,43) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (106)** | **(0,43)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 28.673** | **117,64** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (4.299)** | **(17,64)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 24.374** | **100,00** |

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

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

(a) Nullkuponwertpapier.

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

(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

(d) Mit dem Fonds verbunden.

**Barmittel in Höhe von USD 582 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**(e) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 2,550 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 2.500 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 | $ (2.556) | $ 2.500 | $ 2.500 | 10,26 |
| TDM | 2,600 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 1.900 | U.S. Treasury Bonds 3,125 % fällig am 15.08.2044 | (1.968) | 1.900 | 1.900 | 7,80 |
| SSB | 1,350 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 3.260 | U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021 | (334) | 326 | 326 | 1,33 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (4.858)** | **$ 4.726** | **$ 4.726** | **19,39** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 30 | $ 28.063 | $ 0 | $ 28.093 |
| Finanzderivate[3] | (90) | 776 | 0 | 686 |
| Leerverkäufe | 0 | (106) | 0 | (106) |
| **Summen** | **$ (60)** | **$ 28.733** | **$ 0** | **$ 28.673** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 3.774 | $ 37.958 | $ 0 | $ 41.732 |
| Finanzderivate[3] | (103) | (555) | 0 | (658) |
| Leerverkäufe | 0 | (105) | 0 | (105) |
| **Summen** | **$ 3.671** | **$ 37.298** | **$ 0** | **$ 40.969** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BPS | $ 4 | $ 0 | $ 4 |
| BRC | (10) | 0 | (10) |
| CBK | (8) | 0 | (8) |
| DUB | (2) | 0 | (2) |
| FBF | 21 | 0 | 21 |
| HUS | (36) | 0 | (36) |
| IND | (8) | 0 | (8) |
| JPM | 299 | (290) | 9 |
| MEI | 978 | (860) | 118 |
| NGF | (8) | 0 | (8) |
| RBC | 2 | 0 | 2 |
| SCX | (4) | 0 | (4) |
| SOG | 10 | 0 | 10 |
| TOR | 2 | 0 | 2 |
| UAG | 4 | 0 | 4 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 22,74 | 63,62 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 73,13 | 60,93 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 19,39 | 0,42 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,37) | (0,31) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,92) | (0,84) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 5,10 | (0,82) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,43) | (0,31) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,00 | 1,26 |
| Brasilien | 0,00 | 0,57 |
| Kanada | 0,00 | 0,64 |
| Frankreich | 0,00 | 0,69 |
| Deutschland | 0,00 | 1,56 |
| Irland | 0,00 | 11,30 |
| Italien | 0,00 | 0,55 |
| Japan | 0,00 | 2,30 |
| Niederlande | 0,00 | 2,40 |
| Peru | 0,00 | 0,09 |
| Großbritannien | 0,00 | 5,11 |
| Vereinigte Staaten | 54,82 | 82,96 |
| Kurzfristige Instrumente | 60,31 | 15,45 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,13 | 0,09 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,37) | (0,31) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,10 | 0,00 |
| Zinsswaps | (2,02) | (0,84) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoption | 0,00 | 1,00 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | 0,00 | (0,02) |
| Zinsswapoption | 0,00 | (1,05) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,00 | 0,01 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 5,27 | (0,28) |
| Devisenterminkontrakte | (0,17) | (0,48) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,43) | (0,31) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (17,64) | (22,69) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **USA** | | | |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 26.000 | $ 26.570 | 14,34 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 12.000 | 12.400 | 6,69 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2049 | 800 | 836 | 0,45 |
| | | 39.806 | 21,48 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 2,750 % fällig am 15.08.2047 | 3.100 | 3.236 | 1,74 |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049 | 2.800 | 3.076 | 1,66 |
| 4,375 % fällig am 15.05.2040 | 4.700 | 6.259 | 3,38 |
| 4,625 % fällig am 15.02.2040 | 3.400 | 4.669 | 2,52 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 | 6.724 | $ 6.672 | 3,60 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 | 4.666 | 4.654 | 2,51 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | 3.005 | 3.164 | 1,70 |
| 2,000 % fällig am 15.01.2026 | 3.476 | 3.869 | 2,09 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 31.10.2021 | 38.800 | 39.040 | 21,06 |
| 2,125 % fällig am 31.03.2024 | 15.500 | 15.761 | 8,50 |
| 2,250 % fällig am 31.03.2026 | 40.500 | 41.506 | 22,39 |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 | 9.200 | 9.703 | 5,24 |
| | | 141.609 | 76,39 |
| Summe USA | | 181.415 | 97,87 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (e)** | | | |
| | | 31.744 | 17,12 |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 2,248 % fällig am 12.07.2019 (a)(b) | 4.000 | $ 3.997 | 2,16 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 35.741 | 19,28 |
| **AKTIEN** | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | 1.391 | 14 | 0,01 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 217.170** | **117,16** |

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

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

### FUTURES

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar March Futures | Short | 03/2020 | 318 | $ (598) | (0,32) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 183,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 12 | 0 | 0,00 |
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Short | 09/2019 | 48 | (114) | (0,06) |
| Mini MSCI EAFE Index September Futures | Short | 09/2019 | 73 | (192) | (0,10) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 129,750 EUR auf Euro-Bobl September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 37 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 110,000 GBP auf United Kingdom Gilt September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 79 | (1) | 0,00 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 173 | (285) | (0,15) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 139 | (64) | (0,04) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 8 | (5) | 0,00 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 49 | (269) | (0,15) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09/2019 | 22 | (109) | (0,06) |
| | | | | $ (1.637) | (0,88) |

[1] Future-Style-Option.

### OPTIONSKAUF

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | $ 109,500 | 23.08.2019 | 57 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 110,000 | 23.08.2019 | 27 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 2-Year Note September 2019 Futures | 111,250 | 23.08.2019 | 76 | 1 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 128,750 | 23.08.2019 | 80 | 1 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 129,000 | 23.08.2019 | 46 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 144,500 | 23.08.2019 | 1 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 146,000 | 23.08.2019 | 7 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 193,000 | 23.08.2019 | 42 | 0 | 0 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | 230,000 | 23.08.2019 | 19 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 3 | $ 0 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (1.637)** | **(0,88)** |

## ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)

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

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 101.700 | $ 166 | 0,09 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 % | 21.06.2024 | $ 200 | $ (7) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 21.12.2026 | 6.800 | (32) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 20.06.2025 | 23.100 | (1.729) | (0,93) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,240 | 23.06.2022 | 54.300 | (329) | (0,18) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 20.06.2028 | 200 | 4 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 03.12.2025 | 6.400 | (186) | (0,10) |
| Zahlung[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 15.12.2023 | 51.700 | 831 | 0,45 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.12.2027 | 500 | (16) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,700 | 14.12.2023 | 15.100 | 780 | 0,42 |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 15.12.2026 | 27.400 | (502) | (0,27) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,930 | 05.03.2022 | 82.000 | (1.064) | (0,57) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,933 | 31.05.2025 | 4.300 | (277) | (0,15) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 9.600 | (35) | (0,02) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 15.02.2036 | 15.600 | 2.017 | 1,09 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 15.05.2044 | 9.900 | (1.592) | (0,86) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2049 | 6.700 | (570) | (0,31) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,010 | 28.09.2023 | 19.900 | 1.186 | 0,64 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,080 | 28.09.2048 | 1.600 | (313) | (0,17) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,093 | 14.12.2048 | 2.100 | (403) | (0,22) |
| | | | | | $ (2.237) | (1,21) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (2.071)** | **(1,12)** |

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF WERTPAPIERE**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | $ 70,000 | 08.07.2019 | 27.700 | $ 1 | $ 0 | 0,00 |

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

**TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES**

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeits-datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss-prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| JPM | Erhalt | ERAGDEVT Index | 23.772 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 49.338 | 06.11.2019 | $ 0 | $ 1.214 | $ 1.214 | 0,65 |
| MEI | Erhalt | ERAGDEVT Index | 39.425 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 78.814 | 20.02.2020 | 0 | 4.935 | 4.935 | 2,66 |
| MYI | Erhalt | ERAGDEVT Index | 29.669 | 1-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 61.577 | 13.11.2019 | 0 | 1.515 | 1.515 | 0,82 |
| | | | | | | | $ 0 | $ 7.664 | $ 7.664 | 4,13 |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CAD 2.808 | $ 2.084 | $ 0 | $ (65) | $ (65) | (0,03) |
| | 07/2019 | € 127 | 143 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 121 | DKK 805 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 09/2019 | ILS 183 | $ 51 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € 525 | 592 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK 95 | 11 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 15 | ARS 747 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | 231 | CAD 310 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 07/2019 | 106 | CHF 106 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | 335 | € 299 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | 630 | TWD 19.814 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | 13 | ARS 590 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | 1 | MXN 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09/2019 | CNY 11.548 | $ 1.667 | $ 0 | $ (14) | $ (14) | (0,01) |
| | 10/2019 | MXN 25 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € 5.748 | 6.428 | 0 | (117) | (117) | (0,06) |
| | 10/2019 | $ 1 | MXN 25 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD 154 | $ 107 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ 585.200 | 5.371 | 0 | (60) | (60) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ 1.144 | CAD 1.543 | 37 | 0 | 37 | 0,02 |
| | 07/2019 | 534 | € 478 | 10 | 0 | 10 | 0,01 |
| | 07/2019 | 5.193 | ¥ 563.500 | 38 | 0 | 38 | 0,02 |
| | 09/2019 | 231 | HKD 1.808 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | 1.665 | £ 1.312 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 09/2019 | 163 | TWD 5.105 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 14 | ARS 709 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | 3 | € 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | 1.638 | CNH 11.382 | 17 | 0 | 17 | 0,01 |
| | 11/2019 | TWD 38.459 | $ 1.228 | 0 | (21) | (21) | (0,01) |
| | 11/2019 | $ 5.268 | CNH 35.693 | 0 | (81) | (81) | (0,04) |
| | 01/2021 | BRL 1.150 | $ 177 | 0 | (108) | (108) | (0,06) |
| JPM | 07/2019 | $ 4.947 | € 4.375 | 36 | 0 | 36 | 0,02 |
| | 09/2019 | 1.291 | TWD 40.677 | 27 | 0 | 27 | 0,02 |
| | 11/2019 | CNH 20.810 | $ 2.975 | 0 | (49) | (49) | (0,03) |
| | 11/2019 | TWD 27.889 | 890 | 0 | (16) | (16) | (0,01) |
| MSB | 07/2019 | BRL 900 | 235 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | TWD 19.814 | 629 | 0 | (10) | (10) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ 234 | BRL 900 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 11/2019 | 631 | TWD 19.814 | 13 | 0 | 13 | 0,01 |
| SCX | 07/2019 | £ 1.496 | $ 1.893 | 0 | (11) | (11) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 223 | BRL 900 | 12 | 0 | 12 | 0,01 |
| | 11/2019 | CNH 14.883 | $ 2.126 | 0 | (37) | (37) | (0,02) |
| SSB | 07/2019 | CHF 115 | 115 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK 730 | 110 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 226 | CHF 226 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 07/2019 | 110 | DKK 730 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | 202 | ¥ 21.700 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ 21.700 | $ 202 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 233 | $ (602) | $ (369) | (0,20) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD 232 | $ 159 | $ 0 | $ (4) | $ (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | CHF 6.504 | 6.484 | 0 | (186) | (186) | (0,10) |
| | 07/2019 | € 58.907 | 66.786 | 0 | (297) | (297) | (0,16) |
| | 07/2019 | £ 285 | 357 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ 56.184 | 519 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK 2.366 | 272 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 4.627 | AUD 6.635 | 28 | 0 | 28 | 0,01 |
| | 07/2019 | 6.386 | CAD 8.413 | 51 | 0 | 51 | 0,03 |
| | 07/2019 | 88 | DKK 583 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | 568 | £ 448 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD 6.106 | $ 4.268 | 0 | (21) | (21) | (0,01) |
| | 08/2019 | CAD 7.743 | 5.891 | 0 | (39) | (39) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ 57.782 | € 50.717 | 122 | 0 | 122 | 0,07 |
| | 09/2019 | SGD 1.538 | $ 1.123 | 0 | (15) | (15) | (0,01) |
| | 10/2019 | DKK 6.474 | 994 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € 31.220 | 35.473 | 0 | (79) | (79) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ 1.015 | CAD 1.369 | 32 | 0 | 32 | 0,02 |
| | 07/2019 | 447 | CHF 446 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| | 07/2019 | 5.578 | € 4.978 | 92 | 0 | 92 | 0,05 |
| | 07/2019 | 10.289 | £ 8.117 | 41 | 0 | 41 | 0,02 |
| | 07/2019 | 861 | ¥ 93.448 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ 7.469 | $ 9.487 | 0 | (33) | (33) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ 32.251 | € 28.293 | 51 | 0 | 51 | 0,03 |
| BRC | 07/2019 | 63.011 | 56.341 | 1.150 | 0 | 1.150 | 0,62 |
| | 09/2019 | 92 | SGD 126 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD 6.895 | $ 4.773 | 0 | (65) | (65) | (0,04) |
| | 07/2019 | € 51.202 | 58.193 | 1 | (117) | (116) | (0,06) |
| | 07/2019 | ¥ 1.853.013 | 17.009 | 0 | (190) | (190) | (0,10) |
| | 07/2019 | $ 354 | ¥ 38.426 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | 657 | NOK 5.587 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | NOK 5.587 | $ 657 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 57.787 | € 50.717 | 117 | 0 | 117 | 0,06 |
| | 09/2019 | 203 | HKD 1.585 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € 13.947 | $ 15.642 | 0 | (241) | (241) | (0,13) |
| | 07/2019 | $ 752 | £ 595 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD 9.660 | $ 7.166 | 0 | (226) | (226) | (0,12) |
| | 07/2019 | $ 5.270 | CHF 5.149 | 11 | 0 | 11 | 0,01 |
| | 07/2019 | 363 | DKK 2.419 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | CHF | 5.149 | $ | 5.285 | $ 0 | $ (11) | $ (11) | (0,01) |
| | 09/2019 | HKD | 699 | | 89 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | SEK | 18.032 | | 1.881 | 0 | (62) | (62) | (0,03) |
| JPM | 07/2019 | DKK | 9.476 | | 1.439 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| | 07/2019 | NOK | 3.220 | | 368 | 0 | (9) | (9) | (0,01) |
| MYI | 07/2019 | CAD | 295 | | 220 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 247 | AUD | 355 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 994 | CHF | 989 | 21 | 0 | 21 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 54.828 | € | 49.032 | 1.010 | 0 | 1.010 | 0,54 |
| RYL | 07/2019 | | 148 | SEK | 1.405 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 10.877 | $ | 12.213 | 0 | (174) | (174) | (0,09) |
| | 07/2019 | £ | 8.874 | | 11.232 | 0 | (62) | (62) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 95 | AUD | 137 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.008 | ¥ | 109.022 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.693 | SEK | 15.700 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 15.700 | $ | 1.697 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | ILS | 1.531 | | 422 | 0 | (7) | (7) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | CHF | 196 | | 196 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 540 | | 603 | 0 | (12) | (12) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 130 | CAD | 174 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 117 | CHF | 116 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.173 | ¥ | 127.302 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 338 | NZD | 515 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 97 | SEK | 927 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 09/2019 | HKD | 19.383 | $ | 2.476 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ | 63.001 | € | 56.341 | 1.160 | 0 | 1.160 | 0,63 |
| | 07/2019 | | 308 | ¥ | 33.305 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 14.003 | | 1.507.694 | 5 | (14) | (9) | (0,01) |
| | 08/2019 | ¥ | 1.477.214 | $ | 13.757 | 13 | 0 | 13 | 0,01 |
| | | | | | | $ 3.977 | $ (1.906) | $ 2.071 | 1,12 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 9.366** | **5,05** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2049 | $ 800 | $ (846) | (0,46) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (846)** | **(0,46)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 221.982** | **119,75** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (36.612)** | **(19,75)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 185.370** | **100,00** |

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

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

**(a) Nullkuponwertpapier.**

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

**(c) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(d) Mit dem Fonds verbunden.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 50 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 4.884 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 1.160 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(e) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 1.844 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (1.885) | $ 1.844 | $ 1.844 | 0,99 |
| JPS | 2,730 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 29.900 | U.S. Treasury Notes 1,250 % fällig am 29.02.2020 | (30.517) | 29.900 | 29.907 | 16,13 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (32.402)** | **$ 31.744** | **$ 31.751** | **17,12** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund (Forts.)

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 14 | $ 217.156 | $ 0 | $ 217.170 |
| Finanzderivate[3] | (1.637) | 7.295 | 0 | 5.658 |
| Leerverkäufe | 0 | (846) | 0 | (846) |
| **Summen** | **$ (1.623)** | **$ 223.605** | **$ 0** | **$ 221.982** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 19.145 | $ 321.340 | $ 0 | $ 340.485 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 400 | 0 | 400 |
| Finanzderivate[3] | (2.222) | (6.592) | 0 | (8.814) |
| Leerverkäufe | 0 | (837) | 0 | (837) |
| **Summen** | **$ 16.923** | **$ 314.311** | **$ 0** | **$ 331.234** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (440) | $ 300 | $ (140) |
| BPS | 127 | 0 | 127 |
| BRC | 1.034 | 1.080) | (46) |
| CBK | (227) | 270 | 43 |
| GLM | (228) | 0 | (228) |
| HUS | (411) | 310 | (101) |
| IND | (62) | 0 | (62) |
| JPM | 1.196 | (1.000) | 196 |
| MEI | 4.935 | (4.290) | 645 |
| MSB | 3 | 0 | 3 |
| MYI | 2.542 | (2.050) | 492 |
| RYL | 3 | 0 | 3 |
| SCX | (268) | 280 | 12 |
| SOG | (7) | 0 | (7) |
| SSB | 3 | 0 | 3 |
| TOR | 1.162 | (1.190) | (28) |
| UAG | 4 | 0 | 4 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 69,51 | 86,36 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 30,53 | 66,71 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 17,12 | 3,43 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,88) | (1,02) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,12) | (0,76) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 5,05 | (2,27) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,46) | (0,38) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Argentinien | 0,00 | 0,69 |
| Kanada | 0,00 | 0,24 |
| Cayman-Inseln | 0,00 | 0,14 |
| Frankreich | 0,00 | 3,23 |
| Deutschland | 0,00 | 0,47 |
| Hongkong | 0,00 | 0,27 |
| Irland | 0,00 | 8,97 |
| Israel | 0,00 | 0,09 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Italien | 0,00 | 0,83 |
| Japan | 0,00 | 1,22 |
| Niederlande | 0,00 | 0,76 |
| Peru | 0,00 | 0,70 |
| Saudi-Arabien | 0,00 | 0,13 |
| Schweiz | 0,00 | 0,24 |
| Großbritannien | 0,00 | 2,52 |
| Vereinigte Staaten | 97,87 | 119,96 |
| Kurzfristige Instrumente | 19,28 | 16,03 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,01 | 0,01 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,88) | (1,02) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | (0,03) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,09 | 0,01 |
| Zinsswaps | (1,21) | (0,72) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Gekaufte Optionen Zins-Swaptions | 0,00 | 0,78 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Devisenoptionen | 0,00 | (0,02) |
| Optionen Zins-Swaptions | 0,00 | (0,83) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzkauf | 0,00 | 0,04 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,00 | 0,02 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 4,13 | (1,93) |
| Devisenterminkontrakte | (0,20) | (0,47) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,12 | 0,14 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,46) | (0,38) |
| Einlagenzertifikate | 0,00 | 0,18 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (19,75) | (52,25) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAE US Fund

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Amcor PLC (a) | 749 | $ 9 | 0,06 |
| **LUXEMBURG** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Intelsat S.A. (a) | 192 | 4 | 0,03 |
| **SCHWEIZ** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Garrett Motion, Inc. (a) | 22 | 0 | 0,00 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Liberty Global PLC (a) | 293 | 8 | 0,06 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Avon Products, Inc. (a) | 953 | 4 | 0,03 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Linde PLC | 53 | 10 | 0,08 |
| Summe Großbritannien | | 22 | 0,17 |
| **USA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Alphabet, Inc. 'C' (a) | 9 | 10 | 0,08 |
| Altice USA, Inc. 'A' (a) | 303 | 7 | 0,05 |
| AT&T, Inc. | 6.980 | 234 | 1,79 |
| CBS Corp. NVDR 'B' | 858 | 43 | 0,33 |
| CenturyLink, Inc. | 4.659 | 55 | 0,42 |
| Charter Communications, Inc. 'A' (a) | 21 | 8 | 0,06 |
| Comcast Corp. 'A' | 2.543 | 107 | 0,82 |
| Discovery, Inc. 'A' (a) | 500 | 15 | 0,11 |
| Fox Corp. 'A' | 461 | 17 | 0,13 |
| Frontier Communications Corp. (a) | 2.279 | 4 | 0,03 |
| InterActiveCorp (a) | 17 | 4 | 0,03 |
| Interpublic Group of Cos., Inc. | 584 | 13 | 0,10 |
| Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' (a) | 755 | 29 | 0,22 |
| Omnicom Group, Inc. | 275 | 23 | 0,18 |
| Sprint Corp. (a) | 2.736 | 18 | 0,14 |
| T-Mobile US, Inc. (a) | 85 | 6 | 0,04 |
| TEGNA, Inc. | 310 | 5 | 0,04 |
| Telephone & Data Systems, Inc. | 380 | 12 | 0,09 |
| Tribune Media Co. 'A' | 311 | 14 | 0,11 |
| Verizon Communications, Inc. | 4.363 | 249 | 1,91 |
| Viacom, Inc. 'B' | 2.314 | 69 | 0,53 |
| Walt Disney Co. | 1.136 | 159 | 1,22 |
| | | 1.101 | 8,43 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Abercrombie & Fitch Co. 'A' | 962 | 15 | 0,11 |
| Adient PLC | 271 | 7 | 0,05 |
| Advance Auto Parts, Inc. | 23 | 4 | 0,03 |
| American Eagle Outfitters, Inc. | 301 | 5 | 0,04 |
| Ascena Retail Group, Inc. (a) | 935 | 1 | 0,01 |
| AutoNation, Inc. (a) | 188 | 8 | 0,06 |
| AutoZone, Inc. (a) | 8 | 9 | 0,07 |
| Bed Bath & Beyond, Inc. | 3.229 | 38 | 0,29 |
| Best Buy Co., Inc. | 345 | 24 | 0,18 |
| Big Lots, Inc. | 344 | 10 | 0,08 |
| Carnival Corp. | 191 | 9 | 0,07 |
| Carter's, Inc. | 50 | 5 | 0,04 |
| Dick's Sporting Goods, Inc. | 370 | $ 13 | 0,10 |
| Dillard's, Inc. 'A' | 228 | 14 | 0,11 |
| Dollar General Corp. | 220 | 30 | 0,23 |
| eBay, Inc. | 593 | 23 | 0,18 |
| Expedia Group, Inc. | 49 | 7 | 0,05 |
| Foot Locker, Inc. | 223 | 9 | 0,07 |
| Ford Motor Co. | 6.171 | 63 | 0,48 |
| Fossil Group, Inc. (a) | 806 | 9 | 0,07 |
| GameStop Corp. 'A' | 2.080 | 11 | 0,08 |
| Gap, Inc. | 934 | 17 | 0,13 |
| General Motors Co. | 2.319 | 89 | 0,68 |
| Genuine Parts Co. | 75 | 8 | 0,06 |
| GNC Holdings, Inc. 'A' (a) | 2.283 | 3 | 0,02 |
| Goodyear Tire & Rubber Co. | 923 | 14 | 0,11 |
| H&R Block, Inc. | 178 | 5 | 0,04 |
| Harley-Davidson, Inc. | 111 | 4 | 0,03 |
| Hasbro, Inc. | 38 | 4 | 0,03 |
| Home Depot, Inc. | 538 | 112 | 0,86 |
| International Game Technology PLC | 287 | 4 | 0,03 |
| Kohl's Corp. | 758 | 36 | 0,28 |
| Kontoor Brands, Inc. (a) | 32 | 1 | 0,01 |
| L Brands, Inc. | 679 | 18 | 0,14 |
| Las Vegas Sands Corp. | 190 | 11 | 0,08 |
| Lowe's Cos., Inc. | 636 | 64 | 0,49 |
| Macy's, Inc. | 1.593 | 34 | 0,26 |
| Mattel, Inc. (a) | 1.427 | 16 | 0,12 |
| McDonald's Corp. | 472 | 98 | 0,75 |
| Newell Brands, Inc. | 269 | 4 | 0,03 |
| NIKE, Inc. 'B' | 331 | 28 | 0,21 |
| Nordstrom, Inc. | 509 | 16 | 0,12 |
| O'Reilly Automotive, Inc. (a) | 52 | 19 | 0,15 |
| Office Depot, Inc. | 3.588 | 7 | 0,05 |
| PulteGroup, Inc. | 191 | 6 | 0,05 |
| PVH Corp. | 40 | 4 | 0,03 |
| Qurate Retail, Inc. (a) | 1.149 | 14 | 0,11 |
| Ralph Lauren Corp. | 113 | 13 | 0,10 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd. | 30 | 4 | 0,03 |
| Sally Beauty Holdings, Inc. (a) | 883 | 12 | 0,09 |
| Signet Jewelers Ltd. | 586 | 10 | 0,08 |
| Six Flags Entertainment Corp. | 63 | 3 | 0,02 |
| Starbucks Corp. | 48 | 4 | 0,03 |
| Tapestry, Inc. | 226 | 7 | 0,05 |
| Target Corp. | 1.299 | 113 | 0,87 |
| TJX Cos., Inc. | 608 | 32 | 0,24 |
| Tractor Supply Co. | 51 | 6 | 0,05 |
| Tupperware Brands Corp. | 271 | 5 | 0,04 |
| Urban Outfitters, Inc. (a) | 189 | 4 | 0,03 |
| VF Corp. | 210 | 18 | 0,14 |
| Visteon Corp. (a) | 245 | 14 | 0,11 |
| Wendy's Co. | 463 | 9 | 0,07 |
| Whirlpool Corp. | 104 | 15 | 0,11 |
| Williams-Sonoma, Inc. | 112 | 7 | 0,05 |
| Wyndham Destinations, Inc. | 224 | 10 | 0,08 |
| Yum! Brands, Inc. | 322 | 36 | 0,28 |
| | | 1.272 | 9,74 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Altria Group, Inc. | 583 | 28 | 0,21 |
| Archer-Daniels-Midland Co. | 869 | 35 | 0,27 |
| Bunge Ltd. | 269 | 15 | 0,11 |
| Campbell Soup Co. | 91 | 4 | 0,03 |
| Coca-Cola Co. | 1.835 | 93 | 0,71 |
| Colgate-Palmolive Co. | 336 | 24 | 0,18 |
| Costco Wholesale Corp. | 114 | 30 | 0,23 |
| Flowers Foods, Inc. | 211 | 5 | 0,04 |
| General Mills, Inc. | 630 | 33 | 0,25 |
| Herbalife Nutrition Ltd. (a) | 319 | 14 | 0,11 |
| JM Smucker Co. | 69 | $ 8 | 0,06 |
| Kimberly-Clark Corp. | 163 | 22 | 0,17 |
| Kraft Heinz Co. | 372 | 12 | 0,09 |
| Kroger Co. | 3.473 | 75 | 0,57 |
| Molson Coors Brewing Co. | 66 | 4 | 0,03 |
| Mondelez International, Inc. 'A' | 1.356 | 73 | 0,56 |
| Nu Skin Enterprises, Inc. 'A' | 108 | 5 | 0,04 |
| PepsiCo, Inc. | 992 | 130 | 1,00 |
| Philip Morris International, Inc. | 1.014 | 80 | 0,61 |
| Procter & Gamble Co. | 1.765 | 194 | 1,49 |
| Rite Aid Corp. (a) | 508 | 4 | 0,03 |
| Spectrum Brands Holdings, Inc. | 118 | 6 | 0,05 |
| Sysco Corp. | 267 | 19 | 0,15 |
| U.S. Foods Holding Corp. (a) | 568 | 20 | 0,15 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 1.967 | 217 | 1,66 |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | 454 | 25 | 0,19 |
| | | 1.175 | 8,99 |
| **ENERGIE** | | | |
| Anadarko Petroleum Corp. | 80 | 6 | 0,05 |
| Antero Resources Corp. (a) | 1.016 | 6 | 0,05 |
| Apache Corp. | 479 | 14 | 0,11 |
| Chesapeake Energy Corp. (a) | 7.026 | 14 | 0,11 |
| Chevron Corp. | 1.222 | 152 | 1,16 |
| ConocoPhillips | 996 | 61 | 0,47 |
| CVR Energy, Inc. | 109 | 5 | 0,04 |
| Diamond Offshore Drilling, Inc. (a) | 1.096 | 10 | 0,08 |
| Exxon Mobil Corp. | 3.902 | 299 | 2,29 |
| Helmerich & Payne, Inc. | 102 | 5 | 0,04 |
| Hess Corp. | 577 | 37 | 0,28 |
| HollyFrontier Corp. | 335 | 15 | 0,11 |
| Kinder Morgan, Inc. | 2.749 | 57 | 0,44 |
| Marathon Oil Corp. | 1.390 | 20 | 0,15 |
| Marathon Petroleum Corp. | 514 | 29 | 0,22 |
| Murphy Oil Corp. | 790 | 19 | 0,15 |
| Nabors Industries Ltd. | 3.262 | 9 | 0,07 |
| National Oilwell Varco, Inc. | 689 | 15 | 0,11 |
| Noble Energy, Inc. | 155 | 3 | 0,02 |
| Occidental Petroleum Corp. | 672 | 34 | 0,26 |
| Oceaneering International, Inc. (a) | 529 | 11 | 0,08 |
| PBF Energy, Inc. 'A' | 140 | 4 | 0,03 |
| Phillips 66 | 474 | 44 | 0,34 |
| Schlumberger Ltd. | 96 | 4 | 0,03 |
| Transocean Ltd. | 3.771 | 24 | 0,18 |
| Valero Energy Corp. | 615 | 53 | 0,41 |
| Whiting Petroleum Corp. (a) | 190 | 3 | 0,02 |
| Williams Cos., Inc. | 347 | 10 | 0,08 |
| WPX Energy, Inc. (a) | 232 | 3 | 0,02 |
| | | 966 | 7,40 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Aflac, Inc. | 606 | 33 | 0,25 |
| Allstate Corp. | 350 | 36 | 0,28 |
| Ally Financial, Inc. | 2.475 | 77 | 0,59 |
| American Express Co. | 743 | 92 | 0,70 |
| American International Group, Inc. | 4.249 | 226 | 1,73 |
| Ameriprise Financial, Inc. | 174 | 25 | 0,19 |
| Assurant, Inc. | 151 | 16 | 0,12 |
| Bank of America Corp. | 3.377 | 98 | 0,75 |
| Bank of New York Mellon Corp. | 622 | 27 | 0,21 |
| BB&T Corp. | 437 | 21 | 0,16 |
| Berkshire Hathaway, Inc. 'B' (a) | 587 | 125 | 0,96 |
| BlackRock, Inc. | 24 | 11 | 0,08 |
| Brighthouse Financial, Inc. (a) | 234 | 9 | 0,07 |
| Capital One Financial Corp. | 1.057 | 96 | 0,73 |
| CIT Group, Inc. | 451 | 24 | 0,18 |
| Citigroup, Inc. | 2.375 | 166 | 1,27 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Citizens Financial Group, Inc. | 206 | $ 7 | 0,05 |
| CNO Financial Group, Inc. | 653 | 11 | 0,08 |
| Discover Financial Services | 787 | 61 | 0,47 |
| Fifth Third Bancorp | 811 | 23 | 0,18 |
| Franklin Resources, Inc. | 722 | 25 | 0,19 |
| Genworth Financial, Inc. 'A' (a) | 2.358 | 9 | 0,07 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 212 | 43 | 0,33 |
| Hartford Financial Services Group, Inc. | 398 | 22 | 0,17 |
| Invesco Ltd. | 829 | 17 | 0,13 |
| Jefferies Financial Group, Inc. | 201 | 4 | 0,03 |
| JPMorgan Chase & Co. | 1.593 | 178 | 1,36 |
| Legg Mason, Inc. | 686 | 26 | 0,20 |
| Lincoln National Corp. | 121 | 8 | 0,06 |
| Loews Corp. | 311 | 17 | 0,13 |
| LPL Financial Holdings, Inc. | 44 | 4 | 0,03 |
| MetLife, Inc. | 610 | 30 | 0,23 |
| Navient Corp. | 1.656 | 23 | 0,18 |
| New York Community Bancorp, Inc. | 1.169 | 12 | 0,09 |
| OneMain Holdings, Inc. | 301 | 10 | 0,08 |
| PNC Financial Services Group, Inc. | 230 | 32 | 0,25 |
| Prudential Financial, Inc. | 195 | 20 | 0,15 |
| Regions Financial Corp. | 755 | 11 | 0,08 |
| Reinsurance Group of America, Inc. | 34 | 5 | 0,04 |
| Santander Consumer USA Holdings, Inc. | 794 | 19 | 0,15 |
| SLM Corp. | 610 | 6 | 0,05 |
| State Street Corp. | 295 | 16 | 0,12 |
| SunTrust Banks, Inc. | 214 | 13 | 0,10 |
| Synchrony Financial | 425 | 15 | 0,11 |
| T Rowe Price Group, Inc. | 51 | 6 | 0,05 |
| Travelers Cos., Inc. | 667 | 100 | 0,77 |
| U.S. Bancorp | 1.083 | 57 | 0,44 |
| Voya Financial, Inc. | 881 | 49 | 0,38 |
| Wells Fargo & Co. | 3.936 | 186 | 1,42 |
| White Mountains Insurance Group Ltd. | 13 | 13 | 0,10 |
| | | 2.160 | 16,54 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Abbott Laboratories | 405 | 34 | 0,26 |
| AbbVie, Inc. | 450 | 33 | 0,25 |
| Allergan PLC | 332 | 56 | 0,43 |
| Amgen, Inc. | 309 | 57 | 0,44 |
| Anthem, Inc. | 265 | 75 | 0,57 |
| Bausch Health Cos., Inc. (a) | 1.933 | 49 | 0,37 |
| Bristol-Myers Squibb Co. | 451 | 20 | 0,15 |
| Brookdale Senior Living, Inc. (a) | 1.430 | 10 | 0,08 |
| Cardinal Health, Inc. | 469 | 22 | 0,17 |
| Celgene Corp. (a) | 196 | 18 | 0,14 |
| Cigna Corp. | 207 | 33 | 0,25 |
| Community Health Systems, Inc. (a) | 1.355 | 4 | 0,03 |
| CVS Health Corp. | 2.247 | 122 | 0,93 |
| DaVita, Inc. (a) | 224 | 13 | 0,10 |
| Eli Lilly & Co. | 235 | 26 | 0,20 |
| Encompass Health Corp. | 97 | 6 | 0,05 |
| Gilead Sciences, Inc. | 1.781 | 120 | 0,92 |
| HCA Healthcare, Inc. | 802 | 108 | 0,83 |
| Henry Schein, Inc. (a) | 73 | 5 | 0,04 |
| Humana, Inc. | 61 | 16 | 0,12 |
| Johnson & Johnson | 1.194 | 166 | 1,27 |
| Mallinckrodt PLC (a) | 1.153 | 11 | 0,08 |
| McKesson Corp. | 160 | 21 | 0,16 |
| MEDNAX, Inc. (a) | 303 | 8 | 0,06 |
| Merck & Co., Inc. | 2.547 | 213 | 1,63 |
| Patterson Cos., Inc. | 438 | 10 | 0,08 |
| Pfizer, Inc. | 6.963 | $ 302 | 2,31 |
| Quest Diagnostics, Inc. | 126 | 13 | 0,10 |
| Tenet Healthcare Corp. (a) | 1.002 | 21 | 0,16 |
| United Therapeutics Corp. (a) | 72 | 6 | 0,05 |
| UnitedHealth Group, Inc. | 295 | 72 | 0,55 |
| Universal Health Services, Inc. 'B' | 123 | 16 | 0,12 |
| | | 1.686 | 12,90 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| 3M Co. | 244 | 42 | 0,32 |
| AGCO Corp. | 110 | 9 | 0,07 |
| Alaska Air Group, Inc. | 63 | 4 | 0,03 |
| Allison Transmission Holdings, Inc. | 87 | 4 | 0,03 |
| American Airlines Group, Inc. | 2.229 | 73 | 0,56 |
| Arcosa, Inc. | 99 | 4 | 0,03 |
| Avis Budget Group, Inc. (a) | 1.119 | 39 | 0,30 |
| Caterpillar, Inc. | 49 | 7 | 0,05 |
| Colfax Corp. (a) | 135 | 4 | 0,03 |
| CSX Corp. | 284 | 22 | 0,17 |
| Cummins, Inc. | 113 | 19 | 0,15 |
| Deere & Co. | 189 | 31 | 0,24 |
| Delta Air Lines, Inc. | 204 | 12 | 0,09 |
| Eaton Corp. PLC | 279 | 23 | 0,18 |
| Emerson Electric Co. | 612 | 41 | 0,31 |
| Expeditors International of Washington, Inc. | 79 | 6 | 0,05 |
| FedEx Corp. | 146 | 24 | 0,18 |
| Flowserve Corp. | 221 | 12 | 0,09 |
| Fluor Corp. | 274 | 9 | 0,07 |
| General Dynamics Corp. | 144 | 26 | 0,20 |
| General Electric Co. | 25.679 | 270 | 2,07 |
| HD Supply Holdings, Inc. (a) | 86 | 3 | 0,02 |
| Hertz Global Holdings, Inc. (a) | 1.987 | 32 | 0,24 |
| Honeywell International, Inc. | 191 | 33 | 0,25 |
| Illinois Tool Works, Inc. | 163 | 25 | 0,19 |
| Ingersoll-Rand PLC | 31 | 4 | 0,03 |
| JetBlue Airways Corp. (a) | 702 | 13 | 0,10 |
| L3 Technologies, Inc. | 30 | 7 | 0,05 |
| Macquarie Infrastructure Corp. | 92 | 4 | 0,03 |
| ManpowerGroup, Inc. | 197 | 19 | 0,15 |
| Neilsen Holdings PLC | 612 | 14 | 0,11 |
| Norfolk Southern Corp. | 156 | 31 | 0,24 |
| Northrop Grumman Corp. | 93 | 30 | 0,23 |
| Pitney Bowes, Inc. | 1.558 | 7 | 0,05 |
| Raytheon Co. | 141 | 24 | 0,18 |
| Resideo Technologies, Inc. (a) | 38 | 1 | 0,01 |
| Robert Half International, Inc. | 121 | 7 | 0,05 |
| Ryder System, Inc. | 261 | 15 | 0,11 |
| Southwest Airlines Co. | 121 | 6 | 0,05 |
| Stanley Black & Decker, Inc. | 28 | 4 | 0,03 |
| Trinity Industries, Inc. | 245 | 5 | 0,04 |
| Union Pacific Corp. | 540 | 91 | 0,70 |
| United Continental Holdings, Inc. (a) | 203 | 18 | 0,14 |
| United Parcel Service, Inc. 'B' | 39 | 4 | 0,03 |
| United Rentals, Inc. (a) | 39 | 5 | 0,04 |
| United Technologies Corp. | 622 | 81 | 0,62 |
| Waste Management, Inc. | 109 | 13 | 0,10 |
| WESCO International, Inc. (a) | 159 | 8 | 0,06 |
| WW Grainger, Inc. | 57 | 15 | 0,11 |
| | | 1.200 | 9,18 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Activision Blizzard, Inc. | 128 | 6 | 0,05 |
| Amdocs Ltd. | 125 | 8 | 0,06 |
| Apple, Inc. | 2.325 | 460 | 3,52 |
| Applied Materials, Inc. | 212 | 10 | 0,08 |
| Arrow Electronics, Inc. (a) | 217 | $ 16 | 0,12 |
| Avaya Holdings Corp. (a) | 541 | 6 | 0,05 |
| Avnet, Inc. | 469 | 21 | 0,16 |
| Booz Allen Hamilton Holding Corp. | 365 | 24 | 0,18 |
| Cisco Systems, Inc. | 2.133 | 117 | 0,90 |
| Conduent, Inc. (a) | 602 | 6 | 0,05 |
| Corning, Inc. | 2.499 | 83 | 0,64 |
| DXC Technology Co. | 146 | 8 | 0,06 |
| F5 Networks, Inc. (a) | 51 | 7 | 0,05 |
| First Data Corp. 'A' (a) | 151 | 4 | 0,03 |
| First Solar, Inc. (a) | 64 | 4 | 0,03 |
| Fiserv, Inc. (a) | 93 | 9 | 0,07 |
| Flex Ltd. (a) | 1.068 | 10 | 0,08 |
| Genpact Ltd. | 128 | 5 | 0,04 |
| Hewlett Packard Enterprise Co. | 3.829 | 57 | 0,44 |
| HP, Inc. | 786 | 16 | 0,12 |
| Intel Corp. | 3.352 | 161 | 1,23 |
| International Business Machines Corp. | 2.206 | 304 | 2,33 |
| Intuit, Inc. | 28 | 7 | 0,05 |
| Jabil, Inc. | 558 | 18 | 0,14 |
| Juniper Networks, Inc. | 938 | 25 | 0,19 |
| KLA-Tencor Corp. | 99 | 12 | 0,09 |
| Microsoft Corp. | 1.800 | 241 | 1,84 |
| Motorola Solutions, Inc. | 306 | 51 | 0,39 |
| NCR Corp. (a) | 118 | 4 | 0,03 |
| NetApp, Inc. | 423 | 26 | 0,20 |
| Oracle Corp. | 1.860 | 106 | 0,81 |
| QUALCOMM, Inc. | 2.318 | 176 | 1,35 |
| Seagate Technology PLC | 1.508 | 71 | 0,54 |
| Symantec Corp. | 1.011 | 22 | 0,17 |
| Teradata Corp. (a) | 396 | 14 | 0,11 |
| Texas Instruments, Inc. | 253 | 29 | 0,22 |
| Western Digital Corp. | 237 | 11 | 0,08 |
| Western Union Co. | 1.027 | 20 | 0,15 |
| Xerox Corp. | 832 | 30 | 0,23 |
| Xilinx, Inc. | 81 | 10 | 0,08 |
| | | 2.215 | 16,96 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Alcoa Corp. (a) | 150 | 3 | 0,02 |
| Ashland Global Holdings, Inc. | 97 | 8 | 0,06 |
| CF Industries Holdings, Inc. | 125 | 6 | 0,05 |
| Domtar Corp. | 265 | 12 | 0,09 |
| Eastman Chemical Co. | 40 | 3 | 0,02 |
| Graphic Packaging Holding Co. | 287 | 4 | 0,03 |
| International Paper Co. | 480 | 21 | 0,16 |
| LyondellBasell Industries NV 'A' | 860 | 74 | 0,57 |
| Mosaic Co. | 1.475 | 37 | 0,28 |
| Newmont Goldcorp Corp. | 188 | 7 | 0,06 |
| PPG Industries, Inc. | 189 | 22 | 0,17 |
| Reliance Steel & Aluminum Co. | 75 | 7 | 0,05 |
| Sealed Air Corp. | 274 | 12 | 0,09 |
| | | 216 | 1,65 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Jones Lang LaSalle, Inc. | 31 | 4 | 0,03 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| AES Corp. | 3.410 | 57 | 0,44 |
| Ameren Corp. | 369 | 28 | 0,22 |
| American Electric Power Co., Inc. | 589 | 52 | 0,40 |
| CenterPoint Energy, Inc. | 582 | 17 | 0,13 |
| CMS Energy Corp. | 221 | 13 | 0,10 |
| Consolidated Edison, Inc. | 532 | 47 | 0,36 |
| Dominion Energy, Inc. | 49 | 4 | 0,03 |
| DTE Energy Co. | 53 | 7 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Duke Energy Corp. | 1.109 | $ 98 | 0,75 |
| Edison International | 587 | 39 | 0,30 |
| Entergy Corp. | 535 | 55 | 0,42 |
| Eversource Energy | 307 | 23 | 0,18 |
| Exelon Corp. | 1.665 | 80 | 0,61 |
| FirstEnergy Corp. | 946 | 40 | 0,31 |
| Hawaiian Electric Industries, Inc. | 120 | 5 | 0,04 |
| MDU Resources Group, Inc. | 380 | 10 | 0,08 |
| NextEra Energy, Inc. | 142 | 29 | 0,22 |
| NRG Energy, Inc. | 107 | 4 | 0,03 |
| OGE Energy Corp. | 90 | 4 | 0,03 |
| Pinnacle West Capital Corp. | 136 | 13 | 0,10 |
| Portland General Electric Co. | 98 | 5 | 0,04 |
| PPL Corp. | 1.191 | 37 | 0,28 |
| Public Service Enterprise Group, Inc. | 596 | 35 | 0,27 |
| Southern Co. | 679 | 37 | 0,28 |
| UGI Corp. | 126 | 7 | 0,05 |
| Vistra Energy Corp. | 932 | 21 | 0,16 |
| WEC Energy Group, Inc. | 50 | $ 4 | 0,03 |
| Xcel Energy, Inc. | 494 | 29 | 0,22 |
| | | 800 | 6,13 |
| Summe USA | | 12.795 | 97,95 |
| Summe Stammaktien | | 12.830 | 98,21 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | |
| Annaly Capital Management, Inc. | 956 | 9 | 0,07 |
| Brixmor Property Group, Inc. | 274 | 5 | 0,04 |
| Chimera Investment Corp. | 201 | 4 | 0,03 |
| CoreCivic, Inc. | 543 | 11 | 0,08 |
| Equity Residential | 101 | 8 | 0,06 |
| HCP, Inc. | 480 | 15 | 0,12 |
| Hospitality Properties Trust | 411 | 10 | 0,08 |
| Host Hotels & Resorts, Inc. | 490 | 9 | 0,07 |
| Iron Mountain, Inc. | 117 | 4 | 0,03 |
| Kimco Realty Corp. | 278 | 5 | 0,04 |
| Park Hotels & Resorts, Inc. | 240 | 7 | 0,05 |
| Senior Housing Properties Trust | 1.013 | $ 8 | 0,06 |
| SL Green Realty Corp. | 65 | 5 | 0,04 |
| Ventas, Inc. | 273 | 19 | 0,15 |
| VEREIT, Inc. | 824 | 7 | 0,05 |
| Welltower, Inc. | 260 | 21 | 0,16 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | 147 | 1,13 |
| **RECHTE** | | | |
| Hertz Global Holdings, Inc. - Exp. 12.07.2019 | 1.987 | 4 | 0,03 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 12.981** | **99,37** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 12.981** | **99,37** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 82** | **0,63** |
| **Nettovermögen** | | **$ 13.063** | **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.

**Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 12.981 | $ 0 | $ 0 | $ 12.981 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 11.455 | $ 0 | $ 0 | $ 11.455 |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 99,37 | 99,39 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Stammaktien | | |
| Irland | 0,00 | 0,19 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,06 | 0,00 |
| Luxemburg | 0,03 | 0,00 |
| Großbritannien | 0,17 | 0,00 |
| Vereinigte Staaten | 97,95 | 98,12 |
| Real Estate Investment Trusts | 1,13 | 1,08 |
| Bezugsrechte | 0,03 | 0,00 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,63 | 0,61 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **BRASILIEN** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Cyrela Brazil Realty S.A. Empreendimentos e Participacoes | 300 | $ 2 | 0,02 |
| Grendene S.A. | 500 | 1 | 0,01 |
| Kroton Educacional S.A. | 3.500 | 10 | 0,09 |
| Lojas Renner S.A. | 1.650 | 20 | 0,18 |
| Petrobras Distribuidora S.A. | 1.500 | 10 | 0,09 |
| | | 43 | 0,39 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Ambev S.A. ADR | 11.000 | 51 | 0,47 |
| Atacadao S.A. | 300 | 2 | 0,02 |
| BRF S.A. (a) | 3.400 | 26 | 0,24 |
| JBS S.A. | 17.000 | 94 | 0,86 |
| M Dias Branco S.A. | 300 | 3 | 0,03 |
| Natura Cosmeticos S.A. | 1.500 | 22 | 0,20 |
| Raia Drogasil S.A. | 300 | 6 | 0,06 |
| | | 204 | 1,88 |
| **ENERGIE** | | | |
| Cosan S.A. | 100 | 1 | 0,01 |
| Petroleo Brasileiro S.A. SP - ADR | 6.900 | 108 | 0,99 |
| Ultrapar Participacoes S.A. | 3.800 | 20 | 0,18 |
| | | 129 | 1,18 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| B3 S.A. - Brasil Bolsa Balcao | 2.700 | 26 | 0,24 |
| Banco Bradesco S.A. ADR | 4.460 | 44 | 0,40 |
| Banco BTG Pactual S.A. | 1.200 | 16 | 0,15 |
| Banco do Brasil S.A. | 3.800 | 53 | 0,49 |
| Banco Santander Brasil S.A. ADR | 182 | 2 | 0,02 |
| BB Seguridade Participacoes S.A. | 1.400 | 12 | 0,11 |
| Porto Seguro S.A. | 200 | 3 | 0,03 |
| Sul America S.A. | 200 | 2 | 0,02 |
| | | 158 | 1,46 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Hypera S.A. | 600 | 5 | 0,04 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| CCR S.A. | 1.100 | 4 | 0,03 |
| Embraer S.A. SP - ADR | 780 | 16 | 0,15 |
| WEG S.A. | 2.700 | 15 | 0,14 |
| | | 35 | 0,32 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Cia Siderurgica Nacional S.A. | 3.700 | 16 | 0,15 |
| Klabin S.A. | 500 | 2 | 0,02 |
| Suzano S.A. | 861 | 7 | 0,07 |
| Vale S.A. SP - ADR | 17.014 | 229 | 2,10 |
| | | 254 | 2,34 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| AES Tiete Energia S.A. | 2.700 | 8 | 0,07 |
| Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo ADR | 311 | 4 | 0,04 |
| Cia de Saneamento de Minas Gerais-COPASA | 100 | 2 | 0,02 |
| Energisa S.A. | 700 | 8 | 0,07 |
| Engie Brasil Energia S.A. | 1.875 | 21 | 0,19 |
| Light S.A. | 900 | 5 | 0,05 |
| Transmissora Alianca de Energia Eletrica S.A. | 1.700 | $ 12 | 0,11 |
| | | 60 | 0,55 |
| Summe Brasilien | | 888 | 8,16 |
| **CHILE** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A. | 124 | 1 | 0,01 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| SACI Falabella | 2.879 | 19 | 0,17 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Cencosud S.A. | 12.380 | 24 | 0,22 |
| Cia Cervecerias Unidas S.A. SP - ADR | 767 | 22 | 0,20 |
| | | 46 | 0,42 |
| **ENERGIE** | | | |
| Empresas COPEC S.A. | 883 | 10 | 0,09 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Banco de Chile | 108.516 | 16 | 0,15 |
| Banco de Credito e Inversiones | 34 | 2 | 0,02 |
| Banco Santander Chile ADR | 34 | 1 | 0,01 |
| Itau CorpBanca | 105.719 | 1 | 0,01 |
| | | 20 | 0,19 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| CAP S.A. | 399 | 5 | 0,05 |
| Empresas CMPC S.A. | 3.075 | 8 | 0,07 |
| Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A. SP - ADR | 146 | 4 | 0,04 |
| | | 17 | 0,16 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| AES Gener S.A. | 26.583 | 7 | 0,07 |
| Aguas Andinas S.A. 'A' | 17.185 | 10 | 0,09 |
| Colbun S.A. | 37.585 | 8 | 0,07 |
| Enel Americas S.A. | 58.220 | 10 | 0,09 |
| Enel Chile S.A. | 111.078 | 11 | 0,10 |
| | | 46 | 0,42 |
| Summe Chile | | 159 | 1,46 |
| **CHINA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| China Communications Services Corp. Ltd. 'H' | 16.000 | 13 | 0,12 |
| China Telecom Corp. Ltd. 'H' | 68.000 | 34 | 0,31 |
| | | 47 | 0,43 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| ANTA Sports Products Ltd. | 2.000 | 14 | 0,13 |
| GOME Retail Holdings Ltd. (a) | 11.000 | 1 | 0,01 |
| Great Wall Motor Co. Ltd. 'H' | 16.500 | 12 | 0,11 |
| Shenzhou International Group Holdings Ltd. | 3.000 | 41 | 0,37 |
| Yum China Holdings, Inc. | 532 | 25 | 0,23 |
| Zhongsheng Group Holdings Ltd. | 500 | 1 | 0,01 |
| | | 94 | 0,86 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Dali Foods Group Co. Ltd. | 13.000 | 8 | 0,07 |
| Hengan International Group Co. Ltd. | 3.500 | 26 | 0,24 |
| Tingyi Cayman Islands Holding Corp. | 10.000 | 17 | 0,16 |
| Uni-President China Holdings Ltd. | 6.000 | 7 | 0,06 |
| Want Want China Holdings Ltd. | 35.000 | $ 28 | 0,26 |
| | | 86 | 0,79 |
| **ENERGIE** | | | |
| China Petroleum & Chemical Corp. 'H' | 152.000 | 104 | 0,95 |
| China Shenhua Energy Co. Ltd. 'H' | 5.500 | 12 | 0,11 |
| CNOOC Ltd. | 46.000 | 78 | 0,72 |
| PetroChina Co. Ltd. 'H' | 22.000 | 12 | 0,11 |
| | | 206 | 1,89 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bank of Communications Co. Ltd. 'H' | 2.000 | 2 | 0,02 |
| China CITIC Bank Corp. Ltd. 'H' | 9.000 | 5 | 0,04 |
| China Galaxy Securities Co. Ltd. 'H' | 2.000 | 1 | 0,01 |
| China Huarong Asset Management Co. Ltd. 'H' | 32.000 | 6 | 0,05 |
| China Life Insurance Co. Ltd. 'H' | 5.000 | 12 | 0,11 |
| China Merchants Bank Co. Ltd. 'H' | 3.500 | 17 | 0,16 |
| China Minsheng Banking Corp. Ltd. 'H' | 1.500 | 1 | 0,01 |
| China Reinsurance Group Corp. 'H' | 26.000 | 5 | 0,04 |
| CITIC Securities Co. Ltd. 'H' | 1.000 | 2 | 0,02 |
| GF Securities Co. Ltd. 'H' | 3.000 | 4 | 0,04 |
| Guotai Junan Securities Co. Ltd. 'H' | 1.800 | 3 | 0,03 |
| Haitong Securities Co. Ltd. 'H' | 1.200 | 1 | 0,01 |
| Huatai Securities Co. Ltd. 'H' | 1.400 | 2 | 0,02 |
| New China Life Insurance Co. Ltd. 'H' | 200 | 1 | 0,01 |
| PICC Property & Casualty Co. Ltd. 'H' | 2.000 | 2 | 0,02 |
| Postal Savings Bank of China Co. Ltd. 'H' | 5.000 | 3 | 0,03 |
| | | 67 | 0,62 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| China Resources Pharmaceutical Group Ltd. | 1.500 | 2 | 0,02 |
| Sinopharm Group Co. Ltd. 'H' | 2.000 | 7 | 0,06 |
| | | 9 | 0,08 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| AviChina Industry & Technology Co. Ltd. 'H' | 4.000 | 2 | 0,02 |
| China Communications Construction Co. Ltd. 'H' | 1.000 | 1 | 0,01 |
| China Railway Construction Corp. Ltd. 'H' | 1.000 | 1 | 0,01 |
| China Railway Group Ltd. 'H' | 1.000 | 1 | 0,01 |
| China Southern Airlines Co. Ltd. 'H' | 6.000 | 4 | 0,04 |
| COSCO SHIPPING Energy Transportation Co. Ltd. 'H' | 2.000 | 1 | 0,01 |
| CRRC Corp. Ltd. 'H' | 1.000 | 1 | 0,01 |
| Jiangsu Expressway Co. Ltd. 'H' | 10.000 | 14 | 0,13 |
| Sinopec Engineering Group Co. Ltd. 'H' | 6.500 | 6 | 0,05 |
| Sinotrans Ltd. 'H' | 9.000 | 3 | 0,03 |
| Sinotruk Hong Kong Ltd. | 3.000 | 5 | 0,05 |
| Weichai Power Co. Ltd. 'H' | 4.000 | 7 | 0,06 |
| Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd. | 11.100 | 13 | 0,12 |
| Zhejiang Expressway Co. Ltd. 'H' | 6.000 | 6 | 0,05 |
| Zhuzhou CRRC Times Electric Co. Ltd. 'H' | 2.000 | 11 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| ZTO Express Cayman, Inc. ADR | 744 | $ 14 | 0,13 |
| | | 90 | 0,83 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| AAC Technologies Holdings, Inc. | 500 | 3 | 0,02 |
| AVIC International Holdings Ltd. 'H' | 2.000 | 1 | 0,01 |
| FIH Mobile Ltd. | 19.000 | 2 | 0,02 |
| Lenovo Group Ltd. | 46.000 | 36 | 0,33 |
| | | 42 | 0,38 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Anhui Conch Cement Co. Ltd. 'H' | 2.000 | 12 | 0,11 |
| China BlueChemical Ltd. 'H' | 12.000 | 3 | 0,03 |
| China National Building Material Co. Ltd. 'H' | 32.000 | 28 | 0,26 |
| China Oriental Group Co. Ltd. | 8.000 | 5 | 0,04 |
| Jiangxi Copper Co. Ltd. 'H' | 11.000 | 15 | 0,14 |
| Sinopec Shanghai Petrochemical Co. Ltd. 'H' | 42.000 | 17 | 0,16 |
| Zijin Mining Group Co. Ltd. 'H' | 6.000 | 2 | 0,02 |
| | | 82 | 0,76 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Agile Group Holdings Ltd. | 14.000 | 19 | 0,17 |
| Greentown China Holdings Ltd. | 3.000 | 2 | 0,02 |
| Guangzhou R&F Properties Co. Ltd. 'H' | 2.800 | 5 | 0,05 |
| Kaisa Group Holdings Ltd. | 16.000 | 8 | 0,07 |
| KWG Property Holding Ltd. | 3.000 | 3 | 0,03 |
| Longfor Group Holdings Ltd. | 1.500 | 6 | 0,05 |
| Powerlong Real Estate Holdings Ltd. | 13.000 | 6 | 0,05 |
| Red Star Macalline Group Corp. Ltd. 'H' | 1.200 | 1 | 0,01 |
| Shui On Land Ltd. | 22.000 | 5 | 0,05 |
| Sino-Ocean Group Holding Ltd. | 9.500 | 4 | 0,04 |
| SOHO China Ltd. | 8.000 | 3 | 0,03 |
| Sunac China Holdings Ltd. | 1.000 | 5 | 0,05 |
| | | 67 | 0,62 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Beijing Jingneng Clean Energy Co. Ltd. 'H' | 4.000 | 1 | 0,01 |
| CGN Power Co. Ltd. 'H' | 19.000 | 5 | 0,04 |
| China Longyuan Power Group Corp. Ltd. 'H' | 2.000 | 1 | 0,01 |
| Datang International Power Generation Co. Ltd. 'H' | 10.000 | 3 | 0,03 |
| ENN Energy Holdings Ltd. | 3.000 | 29 | 0,26 |
| Huadian Fuxin Energy Corp. Ltd. 'H' | 14.000 | 3 | 0,03 |
| Huadian Power International Corp. Ltd. 'H' | 6.000 | 2 | 0,02 |
| Huaneng Power International, Inc. 'H' | 24.000 | 14 | 0,13 |
| | | 58 | 0,53 |
| Summe China | | 848 | 7,79 |
| **GRIECHENLAND** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Hellenic Telecommunications Organization S.A. | 250 | 4 | 0,03 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| OPAP S.A. | 1.030 | 12 | 0,11 |
| **ENERGIE** | | | |
| Hellenic Petroleum S.A. | 607 | 6 | 0,06 |
| Motor Oil Hellas Corinth Refineries S.A. | 385 | $ 10 | 0,09 |
| | | 16 | 0,15 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Alpha Bank AE (a) | 4.981 | 10 | 0,09 |
| National Bank of Greece S.A. (a) | 3.741 | 10 | 0,09 |
| Piraeus Bank S.A. (a) | 3.534 | 13 | 0,12 |
| | | 33 | 0,30 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Public Power Corp. S.A. (a) | 638 | 1 | 0,01 |
| Summe Griechenland | | 66 | 0,60 |
| **HONGKONG** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| China Mobile Ltd. | 5.500 | 50 | 0,46 |
| China Unicom Hong Kong Ltd. | 10.000 | 11 | 0,10 |
| | | 61 | 0,56 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Dah Chong Hong Holdings Ltd. | 18.000 | 6 | 0,05 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| China Agri-Industries Holdings Ltd. | 18.000 | 6 | 0,05 |
| China Resources Beer Holdings Co. Ltd. | 14.000 | 66 | 0,61 |
| | | 72 | 0,66 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| China Everbright Ltd. | 4.000 | 6 | 0,05 |
| China Taiping Insurance Holdings Co. Ltd. | 2.200 | 6 | 0,06 |
| Far East Horizon Ltd. | 1.000 | 1 | 0,01 |
| | | 13 | 0,12 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| China Merchants Port Holdings Co. Ltd. | 4.000 | 7 | 0,06 |
| China State Construction International Holdings Ltd. | 4.000 | 4 | 0,04 |
| CITIC Ltd. | 2.000 | 3 | 0,03 |
| COSCO SHIPPING Ports Ltd. | 6.000 | 6 | 0,05 |
| Shanghai Industrial Holdings Ltd. | 1.000 | 2 | 0,02 |
| Shenzhen International Holdings Ltd. | 1.500 | 3 | 0,03 |
| | | 25 | 0,23 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| China Resources Cement Holdings Ltd. | 2.000 | 2 | 0,02 |
| Shougang Fushan Resources Group Ltd. | 30.000 | 7 | 0,06 |
| Sinofert Holdings Ltd. | 8.000 | 1 | 0,01 |
| | | 10 | 0,09 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| China Overseas Land & Investment Ltd. | 20.000 | 74 | 0,68 |
| China Resources Land Ltd. | 12.000 | 53 | 0,49 |
| Poly Property Group Co. Ltd. | 13.000 | 4 | 0,04 |
| Yuexiu Property Co. Ltd. | 48.000 | 11 | 0,10 |
| | | 142 | 1,31 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| China Power International Development Ltd. | 36.000 | 9 | 0,08 |
| China Resources Gas Group Ltd. | 4.000 | 20 | 0,18 |
| China Resources Power Holdings Co. Ltd. | 20.000 | 29 | 0,27 |
| Guangdong Investment Ltd. | 12.000 | 24 | 0,22 |
| Kunlun Energy Co. Ltd. | 18.000 | $ 15 | 0,14 |
| | | 97 | 0,89 |
| Summe Hongkong | | 426 | 3,91 |
| **INDIEN** | | | |
| **ENERGIE** | | | |
| Reliance Industries Ltd. GDR | 4.010 | 145 | 1,33 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Axis Bank Ltd. GDR (a) | 1.929 | 112 | 1,03 |
| HDFC Bank Ltd. ADR | 1.742 | 227 | 2,09 |
| ICICI Bank Ltd. SP - ADR | 11.282 | 142 | 1,30 |
| State Bank of India GDR (a) | 1.430 | 74 | 0,68 |
| | | 555 | 5,10 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Dr Reddy's Laboratories Ltd. ADR | 2.411 | 90 | 0,83 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Infosys Ltd. SP - ADR | 32.111 | 344 | 3,16 |
| Wipro Ltd. ADR | 30.587 | 132 | 1,21 |
| | | 476 | 4,37 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| GAIL India Ltd. | 830 | 23 | 0,21 |
| Summe Indien | | 1.289 | 11,84 |
| **INDONESIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT | 172.900 | 51 | 0,47 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Astra International Tbk PT | 74.500 | 39 | 0,36 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Charoen Pokphand Indonesia Tbk PT | 18.200 | 6 | 0,06 |
| Gudang Garam Tbk PT | 1.800 | 10 | 0,09 |
| Hanjaya Mandala Sampoerna Tbk PT | 49.200 | 11 | 0,10 |
| Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT | 8.100 | 6 | 0,06 |
| Indofood Sukses Makmur Tbk PT | 16.700 | 8 | 0,07 |
| Unilever Indonesia Tbk PT | 3.100 | 10 | 0,09 |
| | | 51 | 0,47 |
| **ENERGIE** | | | |
| Bukit Asam Tbk PT | 33.000 | 7 | 0,06 |
| Indo Tambangraya Megah Tbk PT | 4.400 | 5 | 0,05 |
| | | 12 | 0,11 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bank Central Asia Tbk PT | 12.600 | 27 | 0,25 |
| Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | 37.900 | 11 | 0,10 |
| | | 38 | 0,35 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Kalbe Farma Tbk PT | 9.700 | 1 | 0,01 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| United Tractors Tbk PT | 4.900 | 10 | 0,09 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Indah Kiat Pulp & Paper Corp. Tbk PT | 18.600 | 13 | 0,12 |
| Indocement Tunggal Prakarsa Tbk PT | 5.200 | 7 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Semen Indonesia Persero Tbk PT | 9.600 | $ 8 | 0,07 |
| | | 28 | 0,25 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Perusahaan Gas Negara Tbk PT | 34.000 | 5 | 0,05 |
| Summe Indonesien | | 235 | 2,16 |
| **MALAYSIA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Axiata Group Bhd. | 8.800 | 10 | 0,09 |
| DiGi.Com Bhd. | 6.300 | 8 | 0,07 |
| Maxis Bhd. | 4.400 | 6 | 0,06 |
| Telekom Malaysia Bhd. | 8.900 | 9 | 0,08 |
| | | 33 | 0,30 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Genting Bhd. | 7.800 | 13 | 0,12 |
| Genting Malaysia Bhd. | 11.900 | 9 | 0,08 |
| UMW Holdings Bhd. | 700 | 1 | 0,01 |
| | | 23 | 0,21 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| British American Tobacco Malaysia Bhd. | 1.200 | 8 | 0,08 |
| Felda Global Ventures Holdings Bhd. (a) | 15.400 | 4 | 0,04 |
| IOI Corp. Bhd. | 8.900 | 9 | 0,08 |
| Kuala Lumpur Kepong Bhd. | 2.000 | 12 | 0,11 |
| PPB Group Bhd. | 2.400 | 11 | 0,10 |
| Sime Darby Plantation Bhd. | 800 | 1 | 0,01 |
| | | 45 | 0,42 |
| **ENERGIE** | | | |
| Petronas Dagangan Bhd. | 1.800 | 11 | 0,10 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| AMMB Holdings Bhd. | 2.700 | 3 | 0,02 |
| CIMB Group Holdings Bhd. | 8.200 | 11 | 0,10 |
| Hong Leong Bank Bhd. | 200 | 1 | 0,01 |
| Hong Leong Financial Group Bhd. | 200 | 1 | 0,01 |
| Malayan Banking Bhd. | 12.400 | 27 | 0,25 |
| Public Bank Bhd. | 7.100 | 39 | 0,36 |
| RHB Bank Bhd. | 800 | 1 | 0,01 |
| | | 83 | 0,76 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| IHH Healthcare Bhd. | 800 | 1 | 0,01 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| HAP Seng Consolidated Bhd. | 4.700 | 11 | 0,10 |
| IJM Corp. Bhd. | 10.000 | 6 | 0,06 |
| MISC Bhd. | 4.400 | 8 | 0,07 |
| Sime Darby Bhd. | 25.300 | 14 | 0,13 |
| | | 39 | 0,36 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Astro Malaysia Holdings Bhd. | 6.900 | 2 | 0,02 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Petronas Chemicals Group Bhd. | 8.600 | 17 | 0,16 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| IOI Properties Group Bhd. | 3.100 | 1 | 0,01 |
| Sunway Bhd. | 2.929 | 1 | 0,01 |
| | | 2 | 0,02 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Petronas Gas Bhd. | 2.300 | 10 | 0,09 |
| Tenaga Nasional Bhd. | 7.100 | 24 | 0,22 |
| YTL Corp. Bhd. | 9.600 | 3 | 0,03 |
| YTL Power International Bhd. | 8.000 | $ 1 | 0,01 |
| | | 38 | 0,35 |
| Summe Malaysia | | 294 | 2,71 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **MEXIKO** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Nemak S.A.B. de C.V. | 14.600 | 7 | 0,06 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Arca Continental S.A.B. de C.V. | 1.700 | 9 | 0,08 |
| Coca-Cola Femsa S.A.B. de C.V. SP - ADR | 55 | 3 | 0,03 |
| Fomento Economico Mexicano S.A.B. de C.V. SP - ADR | 281 | 27 | 0,25 |
| Gruma S.A.B. de C.V. 'B' | 1.460 | 14 | 0,13 |
| Grupo Bimbo S.A.B. de C.V. 'A' | 500 | 1 | 0,01 |
| Grupo Lala S.A.B. de C.V. | 3.600 | 5 | 0,05 |
| Industrias Bachoco S.A.B. de C.V. | 1.900 | 8 | 0,07 |
| Kimberly-Clark de Mexico S.A.B. de C.V. 'A' | 10.300 | 19 | 0,18 |
| Wal-Mart de Mexico S.A.B. de C.V. | 35.700 | 97 | 0,89 |
| | | 183 | 1,69 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Grupo Elektra S.A.B. de C.V. | 25 | 1 | 0,01 |
| Grupo Financiero Banorte S.A.B. de C.V. 'O' | 2.200 | 13 | 0,12 |
| | | 14 | 0,13 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Alfa S.A.B. de C.V. 'A' | 3.600 | 3 | 0,03 |
| Grupo Carso S.A.B. de C.V. | 700 | 3 | 0,03 |
| | | 6 | 0,06 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Alpek S.A.B. de C.V. | 700 | 1 | 0,01 |
| Grupo Mexico S.A.B. de C.V. 'B' | 13.100 | 35 | 0,32 |
| | | 36 | 0,33 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Infraestructura Energetica Nova S.A.B. de C.V. | 900 | 4 | 0,03 |
| Summe Mexiko | | 250 | 2,30 |
| **PHILIPPINEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Globe Telecom, Inc. | 250 | 11 | 0,10 |
| PLDT, Inc. | 750 | 19 | 0,17 |
| | | 30 | 0,27 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| San Miguel Food and Beverage, Inc. | 530 | 1 | 0,01 |
| Universal Robina Corp. | 2.180 | 7 | 0,06 |
| | | 8 | 0,07 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bank of the Philippine Islands | 2.930 | 5 | 0,05 |
| BDO Unibank, Inc. | 1.520 | 4 | 0,04 |
| Metro Pacific Investments Corp. | 69.000 | 6 | 0,05 |
| Metropolitan Bank & Trust Co. | 1.450 | 2 | 0,02 |
| | | 17 | 0,16 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Alliance Global Group, Inc. | 11.500 | 3 | 0,03 |
| Ayala Corp. | 690 | 12 | 0,11 |
| DMCI Holdings, Inc. | 33.200 | 7 | 0,06 |
| International Container Terminal Services, Inc. | 1.920 | 6 | 0,05 |
| JG Summit Holdings, Inc. | 860 | 1 | 0,01 |
| San Miguel Corp. | 820 | $ 3 | 0,03 |
| | | 32 | 0,29 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Ayala Land, Inc. | 1.800 | 2 | 0,02 |
| SM Prime Holdings, Inc. | 1.400 | 1 | 0,01 |
| | | 3 | 0,03 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Aboitiz Power Corp. | 2.800 | 2 | 0,02 |
| Manila Electric Co. | 2.040 | 15 | 0,14 |
| | | 17 | 0,16 |
| Total Philippines | | 107 | 0,98 |
| **POLEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Cyfrowy Polsat S.A. | 450 | 4 | 0,04 |
| Orange Polska S.A. (a) | 793 | 1 | 0,01 |
| PLAY Communications S.A. | 741 | 6 | 0,05 |
| | | 11 | 0,10 |
| **ENERGIE** | | | |
| Grupa Lotos S.A. | 579 | 13 | 0,12 |
| Polski Koncern Naftowy ORLEN S.A. | 975 | 24 | 0,22 |
| Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo S.A. | 2.149 | 3 | 0,03 |
| | | 40 | 0,37 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bank Polska Kasa Opieki S.A. | 162 | 5 | 0,04 |
| Powszechny Zaklad Ubezpieczen S.A. | 1.447 | 17 | 0,16 |
| | | 22 | 0,20 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Asseco Poland S.A. | 579 | 8 | 0,08 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Grupa Azoty S.A. | 155 | 2 | 0,02 |
| KGHM Polska Miedz S.A. | 610 | 17 | 0,15 |
| | | 19 | 0,17 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Enea S.A. | 1.004 | 2 | 0,02 |
| Energa S.A. | 1.267 | 3 | 0,03 |
| PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. (a) | 4.163 | 11 | 0,10 |
| Tauron Polska Energia S.A. | 10.120 | 5 | 0,04 |
| | | 21 | 0,19 |
| Summe Polen | | 121 | 1,11 |
| **RUMÄNIEN** | | | |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| NEPI Rockcastle PLC | 125 | 1 | 0,01 |
| **RUSSLAND** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Mobile TeleSystems PJSC SP - ADR | 7.736 | 72 | 0,66 |
| Rostelecom PJSC | 7.230 | 9 | 0,08 |
| Sistema PJSC FC | 40.800 | 7 | 0,07 |
| | | 88 | 0,81 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Magnit PJSC SP - GDR | 1.450 | 21 | 0,19 |
| **ENERGIE** | | | |
| Gazprom Neft PJSC | 610 | 4 | 0,04 |
| Gazprom PJSC | 58.290 | 215 | 1,97 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Lukoil PJSC SP - ADR | 2.037 | $ 171 | 1,57 |
| Novatek PJSC GDR | 78 | 16 | 0,15 |
| Rosneft Oil, Co. PJSC GDR | 6.349 | 42 | 0,39 |
| Tatneft PJSC SP - ADR | 921 | 68 | 0,62 |
| | | 516 | 4,74 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Sberbank of Russia PJSC | 6.460 | 24 | 0,22 |
| VTB Bank PJSC | 45.170.000 | 29 | 0,27 |
| | | 53 | 0,49 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Aeroflot PJSC | 2.100 | 3 | 0,03 |
| Globaltrans Investment PLC GDR | 390 | 4 | 0,03 |
| | | 7 | 0,06 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Alrosa PJSC | 21.900 | 30 | 0,28 |
| Evraz PLC | 566 | 5 | 0,05 |
| Magnitogorsk Iron & Steel Works PJSC | 15.500 | 11 | 0,10 |
| MMC Norilsk Nickel PJSC ADR | 5.723 | 129 | 1,19 |
| Novolipetsk Steel PJSC | 8.260 | 21 | 0,19 |
| PhosAgro PJSC GDR | 658 | 9 | 0,08 |
| Polymetal International PLC | 556 | 7 | 0,06 |
| Polyus PJSC | 140 | 13 | 0,12 |
| Severstal PJSC GDR | 2.100 | 35 | 0,32 |
| | | 260 | 2,39 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Federal Grid Co. Unified Energy System PJSC | 1.370.000 | 4 | 0,04 |
| Inter RAO UES PJSC | 218.000 | 16 | 0,15 |
| Mosenergo PJSC | 39.000 | 1 | 0,01 |
| OGK-2 PJSC | 196.000 | 2 | 0,02 |
| Rosseti PJSC | 94.000 | 2 | 0,02 |
| RusHydro PJSC | 847.000 | 8 | 0,07 |
| Unipro PJSC | 136.000 | 6 | 0,05 |
| | | 39 | 0,36 |
| Summe Russland | | 984 | 9,04 |
| **SINGAPUR** | | | |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| BOC Aviation Ltd. | 400 | 3 | 0,03 |
| **SÜDAFRIKA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| MTN Group Ltd. | 12.453 | 94 | 0,87 |
| Telkom S.A. SOC Ltd. | 1.765 | 11 | 0,10 |
| Vodacom Group Ltd. | 3.530 | 30 | 0,28 |
| | | 135 | 1,25 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Foschini Group Ltd. | 642 | 8 | 0,07 |
| Mr Price Group Ltd. | 773 | 11 | 0,10 |
| Naspers Ltd. 'N' | 404 | 98 | 0,90 |
| Truworths International Ltd. | 1.979 | 10 | 0,09 |
| | | 127 | 1,16 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Bid Corp. Ltd. | 233 | 5 | 0,04 |
| Massmart Holdings Ltd. | 581 | 3 | 0,03 |
| Oceana Group Ltd. | 193 | 1 | 0,01 |
| Pick n Pay Stores Ltd. | 1.084 | 5 | 0,05 |
| Shoprite Holdings Ltd. | 1.344 | 15 | 0,14 |
| SPAR Group Ltd. | 179 | 2 | 0,02 |
| Tiger Brands Ltd. | 749 | 12 | 0,11 |
| | | 43 | 0,40 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ENERGIE** | | | |
| Exxaro Resources Ltd. | 347 | $ 4 | 0,04 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Absa Group Ltd. | 626 | 8 | 0,07 |
| Capitec Bank Holdings Ltd. | 13 | 1 | 0,01 |
| FirstRand Ltd. | 6.240 | 31 | 0,28 |
| Liberty Holdings Ltd. | 137 | 1 | 0,01 |
| Nedbank Group Ltd. | 168 | 3 | 0,03 |
| Sanlam Ltd. | 4.555 | 25 | 0,23 |
| Standard Bank Group Ltd. | 1.430 | 20 | 0,18 |
| | | 89 | 0,81 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Life Healthcare Group Holdings Ltd. | 570 | 1 | 0,01 |
| Netcare Ltd. | 2.123 | 3 | 0,02 |
| | | 4 | 0,03 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Barloworld Ltd. | 1.756 | 16 | 0,15 |
| Imperial Logistics Ltd. | 1.656 | 6 | 0,05 |
| | | 22 | 0,20 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| African Rainbow Minerals Ltd. | 530 | 7 | 0,07 |
| Anglo American Platinum Ltd. | 51 | 3 | 0,03 |
| AngloGold Ashanti Ltd. SP - ADR | 1.754 | 31 | 0,29 |
| Gold Fields Ltd. SP - ADR | 7.600 | 41 | 0,38 |
| Harmony Gold Mining Co. Ltd. SP - ADR (a) | 3.600 | 8 | 0,07 |
| Impala Platinum Holdings Ltd. (a) | 5.788 | 29 | 0,27 |
| Kumba Iron Ore Ltd. | 663 | 23 | 0,21 |
| Sappi Ltd. | 2.059 | 8 | 0,07 |
| Sasol Ltd. | 1.804 | 45 | 0,41 |
| | | 195 | 1,80 |
| Summe Südafrika | | 619 | 5,69 |
| **SÜDKOREA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| KT Corp. SP - ADR | 3.746 | 46 | 0,42 |
| LG Uplus Corp. | 1.593 | 20 | 0,18 |
| NAVER Corp. | 64 | 6 | 0,06 |
| NCSoft Corp. | 6 | 3 | 0,03 |
| SK Telecom Co. Ltd. | 274 | 62 | 0,57 |
| | | 137 | 1,26 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Hankook Tire & Technology Co. Ltd. | 584 | 18 | 0,17 |
| Hanon Systems | 957 | 10 | 0,09 |
| Hyundai Department Store Co. Ltd. | 53 | 4 | 0,04 |
| Hyundai Mobis Co. Ltd. | 622 | 127 | 1,17 |
| Hyundai Motor Co. | 1.579 | 192 | 1,77 |
| Hyundai Wia Corp. | 192 | 8 | 0,07 |
| Kangwon Land, Inc. | 818 | 21 | 0,19 |
| Kia Motors Corp. | 2.579 | 98 | 0,90 |
| LG Electronics, Inc. | 1.067 | 73 | 0,67 |
| LOTTE Himart Co. Ltd. | 210 | 8 | 0,07 |
| Lotte Shopping Co. Ltd. | 169 | 23 | 0,21 |
| Mando Corp. | 41 | 1 | 0,01 |
| Shinsegae, Inc. | 28 | 7 | 0,07 |
| Woongjin Coway Co., Ltd. | 204 | 14 | 0,13 |
| | | 604 | 5,56 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Amorepacific Corp. | 199 | 17 | 0,16 |
| CJ CheilJedang Corp. | 25 | 7 | 0,06 |
| E-MART, Inc. | 125 | 15 | 0,14 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| GS Retail Co. Ltd. | 208 | $ 7 | 0,06 |
| KT&G Corp. | 670 | 57 | 0,52 |
| LG Household & Health Care Ltd. | 31 | 35 | 0,32 |
| NongShim Co. Ltd. | 21 | 5 | 0,05 |
| | | 143 | 1,31 |
| **ENERGIE** | | | |
| E1 Corp. | 19 | 1 | 0,01 |
| GS Holdings Corp. | 391 | 17 | 0,15 |
| S-Oil Corp. | 134 | 10 | 0,09 |
| SK Gas Ltd. | 38 | 3 | 0,03 |
| SK Innovation Co. Ltd. | 531 | 73 | 0,67 |
| | | 104 | 0,95 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| BNK Financial Group, Inc. | 817 | 5 | 0,05 |
| DB Insurance Co. Ltd. | 181 | 9 | 0,08 |
| DGB Financial Group, Inc. | 300 | 2 | 0,02 |
| Hanwha Life Insurance Co. Ltd. | 3.977 | 11 | 0,10 |
| Hyundai Marine & Fire Insurance Co. Ltd. | 268 | 7 | 0,06 |
| Industrial Bank of Korea | 1.390 | 17 | 0,16 |
| KB Financial Group, Inc. | 1.223 | 49 | 0,45 |
| Meritz Financial Group, Inc. | 460 | 6 | 0,06 |
| Meritz Fire & Marine Insurance Co. Ltd. | 370 | 7 | 0,06 |
| NH Investment & Securities Co. Ltd. | 90 | 1 | 0,01 |
| Samsung Card Co. Ltd. | 313 | 10 | 0,09 |
| Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. | 192 | 45 | 0,41 |
| Samsung Life Insurance Co. Ltd. | 309 | 22 | 0,20 |
| Shinhan Financial Group Co. Ltd. | 2.268 | 88 | 0,81 |
| | | 279 | 2,56 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| CJ Corp. | 121 | 11 | 0,10 |
| CJ Logistics Corp. (a) | 8 | 1 | 0,01 |
| Daelim Industrial Co. Ltd. | 136 | 14 | 0,13 |
| Daewoo Engineering & Construction Co. Ltd. (a) | 230 | 1 | 0,01 |
| Doosan Bobcat, Inc. (a) | 38 | 1 | 0,01 |
| Doosan Corp. | 98 | 9 | 0,08 |
| Doosan Heavy Industries & Construction Co. Ltd. | 1.055 | 6 | 0,05 |
| Doosan Infracore Co. Ltd. (a) | 138 | 1 | 0,01 |
| GS Engineering & Construction Corp. | 125 | 4 | 0,04 |
| Hyundai Engineering & Construction Co. Ltd. | 351 | 16 | 0,15 |
| Hyundai Glovis Co. Ltd. | 85 | 12 | 0,11 |
| KCC Corp. | 41 | 10 | 0,09 |
| Korea Shipbuilding & Offshore Engineering Co. Ltd. (a) | 121 | 12 | 0,11 |
| Korean Air Lines Co. Ltd. | 508 | 13 | 0,12 |
| LG Corp. | 353 | 24 | 0,22 |
| LG International Corp. | 281 | 4 | 0,04 |
| LS Corp. | 177 | 7 | 0,06 |
| Pan Ocean Co. Ltd. | 250 | 1 | 0,01 |
| Posco International Corp. | 650 | 10 | 0,09 |
| S-1 Corp. | 39 | 3 | 0,03 |
| Samsung Heavy Industries Co. Ltd. | 469 | 3 | 0,03 |
| SK Holdings Co. Ltd. | 140 | 28 | 0,26 |
| SK Networks Co. Ltd. | 2.251 | 10 | 0,09 |
| | | 201 | 1,85 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| LG Display Co. Ltd. | 3.717 | 58 | 0,53 |
| Samsung Electro-Mechanics Co. Ltd. | 271 | 23 | 0,21 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 3.009 | $ 122 | 1,12 |
| Samsung SDI Co. Ltd. | 21 | 4 | 0,04 |
| Samsung SDS Co. Ltd. | 69 | 13 | 0,12 |
| SK Hynix, Inc. | 880 | 53 | 0,49 |
| | | 273 | 2,51 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Dongkuk Steel Mill Co. Ltd. (a) | 670 | 4 | 0,04 |
| Hyundai Steel Co. | 557 | 20 | 0,18 |
| Kolon Industries, Inc. | 130 | 5 | 0,04 |
| Korea Zinc Co. Ltd. | 36 | 15 | 0,14 |
| Kumho Petrochemical Co. Ltd. | 13 | 1 | 0,01 |
| LG Chem Ltd. | 28 | 9 | 0,08 |
| OCI Co. Ltd. | 35 | 3 | 0,03 |
| POSCO | 425 | 90 | 0,83 |
| Seah Besteel Corp. | 330 | 5 | 0,04 |
| Taekwang Industrial Co. Ltd. | 1 | 1 | 0,01 |
| Young Poong Corp. | 3 | 2 | 0,02 |
| | | 155 | 1,42 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Korea District Heating Corp. (a) | 20 | 1 | 0,01 |
| Korea Electric Power Corp. | 3.935 | 87 | 0,80 |
| Korea Gas Corp. | 303 | 11 | 0,10 |
| | | 99 | 0,91 |
| Summe Südkorea | | 1.995 | 18,33 |
| **TAIWAN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Chunghwa Telecom Co. Ltd. | 21.000 | 76 | 0,70 |
| Far EasTone Telecommunications Co. Ltd. | 8.000 | 20 | 0,18 |
| Taiwan Mobile Co. Ltd. | 9.000 | 36 | 0,33 |
| | | 132 | 1,21 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Cheng Shin Rubber Industry Co. Ltd. | 5.000 | 6 | 0,05 |
| China Motor Corp. | 8.000 | 7 | 0,06 |
| Formosa Taffeta Co. Ltd. | 4.000 | 5 | 0,05 |
| Hotai Motor Co. Ltd. | 1.000 | 16 | 0,15 |
| Pou Chen Corp. | 12.000 | 15 | 0,14 |
| Yulon Motor Co. Ltd. | 2.000 | 2 | 0,02 |
| | | 51 | 0,47 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| President Chain Store Corp. | 4.000 | 39 | 0,36 |
| Uni-President Enterprises Corp. | 22.000 | 58 | 0,53 |
| | | 97 | 0,89 |
| **ENERGIE** | | | |
| Formosa Petrochemical Corp. | 7.000 | 25 | 0,23 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Cathay Financial Holding Co. Ltd. | 8.000 | 11 | 0,10 |
| Chang Hwa Commercial Bank Ltd. | 4.000 | 3 | 0,03 |
| China Development Financial Holding Corp. | 3.000 | 1 | 0,01 |
| China Life Insurance Co. Ltd. | 1.000 | 1 | 0,01 |
| CTBC Financial Holding Co. Ltd. | 61.000 | 42 | 0,39 |
| E.Sun Financial Holding Co. Ltd. | 24.000 | 20 | 0,18 |
| First Financial Holding Co. Ltd. | 26.000 | 19 | 0,17 |
| Fubon Financial Holding Co. Ltd. | 15.000 | 22 | 0,20 |
| Hua Nan Financial Holdings Co. Ltd. 'C' | 11.000 | 7 | 0,06 |
| Mega Financial Holding Co. Ltd. | 39.000 | 39 | 0,36 |
| Shanghai Commercial & Savings Bank Ltd. | 2.000 | 4 | 0,04 |
| Shin Kong Financial Holding Co. Ltd. | 35.000 | $ 11 | 0,10 |
| SinoPac Financial Holdings Co. Ltd. | 17.000 | 7 | 0,06 |
| Taishin Financial Holding Co. Ltd. | 28.000 | 13 | 0,12 |
| Taiwan Cooperative Financial Holding Co. Ltd. | 18.000 | 12 | 0,11 |
| Yuanta Financial Holding Co. Ltd. | 2.000 | 1 | 0,01 |
| | | 213 | 1,95 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| China Airlines Ltd. | 14.000 | 5 | 0,04 |
| Eva Airways Corp. | 2.438 | 1 | 0,01 |
| Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd. | 2.000 | 1 | 0,01 |
| Far Eastern New Century Corp. | 26.000 | 28 | 0,26 |
| Taiwan High Speed Rail Corp. | 2.000 | 3 | 0,03 |
| Walsin Lihwa Corp. | 28.000 | 13 | 0,12 |
| | | 51 | 0,47 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Acer, Inc. | 26.000 | 16 | 0,15 |
| Advantech Co. Ltd. | 1.000 | 8 | 0,07 |
| Asustek Computer, Inc. | 3.000 | 22 | 0,20 |
| AU Optronics Corp. | 72.000 | 22 | 0,20 |
| Catcher Technology Co. Ltd. | 1.000 | 7 | 0,06 |
| Chicony Electronics Co. Ltd. | 4.000 | 10 | 0,09 |
| Compal Electronics, Inc. | 20.000 | 13 | 0,12 |
| Delta Electronics, Inc. | 3.000 | 15 | 0,14 |
| Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. | 33.000 | 82 | 0,75 |
| HTC Corp. (a) | 3.000 | 4 | 0,04 |
| Innolux Corp. | 84.000 | 20 | 0,18 |
| Inventec Corp. | 23.000 | 18 | 0,17 |
| Largan Precision Co. Ltd. | 100 | 12 | 0,11 |
| Lite-On Technology Corp. | 15.000 | 22 | 0,20 |
| MediaTek, Inc. | 3.000 | 30 | 0,28 |
| Micro-Star International Co. Ltd. | 7.000 | 20 | 0,18 |
| Novatek Microelectronics Corp. | 3.000 | 17 | 0,16 |
| Pegatron Corp. | 18.000 | 31 | 0,29 |
| Powertech Technology, Inc. | 6.000 | 15 | 0,14 |
| Quanta Computer, Inc. | 16.000 | 31 | 0,29 |
| Synnex Technology International Corp. | 9.000 | 11 | 0,10 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. SP - ADR | 4.468 | 175 | 1,61 |
| TPK Holding Co. Ltd. | 2.000 | 3 | 0,03 |
| Unimicron Technology Corp. | 1.000 | 1 | 0,01 |
| United Microelectronics Corp. | 17.000 | 8 | 0,07 |
| Wistron Corp. | 23.000 | 18 | 0,17 |
| WPG Holdings Ltd. | 9.000 | 12 | 0,11 |
| Yageo Corp. | 1.000 | 9 | 0,08 |
| | | 652 | 6,00 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Asia Cement Corp. | 16.000 | 24 | 0,22 |
| China Steel Corp. | 38.000 | 31 | 0,28 |
| Formosa Chemicals & Fibre Corp. | 16.000 | 53 | 0,49 |
| Formosa Plastics Corp. | 17.000 | 63 | 0,58 |
| Nan Ya Plastics Corp. | 15.000 | 38 | 0,35 |
| Taiwan Cement Corp. | 28.000 | 41 | 0,38 |
| | | 250 | 2,30 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Highwealth Construction Corp. | 6.000 | 10 | 0,09 |
| Summe Taiwan | | 1.481 | 13,61 |
| **THAILAND** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Advanced Info Service PCL | 6.600 | $ 47 | 0,43 |
| Total Access Communication PCL | 10.900 | 19 | 0,18 |
| | | 66 | 0,61 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Berli Jucker PCL | 600 | 1 | 0,01 |
| Charoen Pokphand Foods PCL | 14.500 | 13 | 0,12 |
| CP ALL PCL | 11.300 | 32 | 0,29 |
| Thai Beverage PCL | 9.000 | 6 | 0,05 |
| Thai Union Group PCL 'F' | 28.400 | 17 | 0,16 |
| | | 69 | 0,63 |
| **ENERGIE** | | | |
| Bangchak Corp. PCL | 11.300 | 11 | 0,10 |
| Esso Thailand PCL | 3.900 | 2 | 0,02 |
| IRPC PCL | 70.700 | 12 | 0,11 |
| PTT Exploration & Production PCL | 1.400 | 6 | 0,05 |
| PTT PCL | 19.600 | 31 | 0,28 |
| Star Petroleum Refining PCL | 47.900 | 16 | 0,15 |
| Thai Oil PCL | 11.200 | 24 | 0,22 |
| | | 102 | 0,93 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bangkok Bank PCL | 4.400 | 28 | 0,26 |
| Kasikornbank PCL | 1.400 | 9 | 0,08 |
| Krung Thai Bank PCL | 13.500 | 8 | 0,08 |
| Siam Commercial Bank PCL | 1.900 | 9 | 0,08 |
| Thanachart Capital PCL | 3.047 | 5 | 0,05 |
| TMB Bank PCL | 14.200 | 1 | 0,01 |
| | | 60 | 0,56 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Bangkok Dusit Medical Services PCL 'F' | 23.000 | 19 | 0,18 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Airports of Thailand PCL | 6.000 | 14 | 0,13 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| PTT Global Chemical PCL | 12.900 | 27 | 0,25 |
| Siam Cement PCL | 5.000 | 77 | 0,71 |
| | | 104 | 0,96 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Central Pattana PCL | 900 | 2 | 0,02 |
| Land & Houses PCL | 54.200 | 20 | 0,18 |
| | | 22 | 0,20 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Electricity Generating PCL | 500 | 5 | 0,05 |
| Ratch Group PCL | 3.200 | 7 | 0,06 |
| | | 12 | 0,11 |
| Summe Thailand | | 468 | 4,31 |
| **TÜRKEI** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Turk Telekomunikasyon A/S (a) | 2.775 | 2 | 0,02 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Arcelik A/S | 339 | 1 | 0,01 |
| Ford Otomotiv Sanayi A/S | 920 | 10 | 0,09 |
| Tofas Turk Otomobil Fabrikasi A/S | 1.326 | 4 | 0,04 |
| | | 15 | 0,14 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| BIM Birlesik Magazalar A/S | 1.321 | $ 18 | 0,17 |
| **ENERGIE** | | | |
| Tupras Turkiye Petrol Rafinerileri A/S | 380 | 8 | 0,07 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Turkiye Halk Bankasi A/S | 750 | 1 | 0,01 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Enka Insaat ve Sanayi A/S | 1.843 | 2 | 0,02 |
| KOC Holding A/S | 390 | 1 | 0,01 |
| Turk Hava Yollari AO (a) | 5.350 | 12 | 0,11 |
| | | 15 | 0,14 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Aygaz A/S | 2.996 | 5 | 0,04 |
| Summe Türkei | | 64 | 0,59 |
| **UKRAINE** | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Kernel Holding S.A. | 72 | 1 | 0,01 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Mondi Ltd. | 390 | 9 | 0,08 |
| **USA** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Nexteer Automotive Group Ltd. | 3.000 | $ 4 | 0,03 |
| Summe Stammaktien | | 10.312 | 94,75 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Bashneft PJSC | 234 | 6 | 0,05 |
| Braskem S.A. | 1.100 | 10 | 0,09 |
| Centrais Eletricas Brasileiras S.A. | 300 | 3 | 0,03 |
| Cia Brasileira de Distribuicao | 300 | 7 | 0,06 |
| Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista | 1.600 | 10 | 0,09 |
| Cia Energetica de Minas Gerais | 16.400 | 64 | 0,59 |
| Cia Energetica de Sao Paulo | 2.800 | 20 | 0,18 |
| Cia Paranaense de Energia | 1.700 | 22 | 0,20 |
| CJ Corp. | 18 | 1 | 0,01 |
| Embotelladora Andina S.A. | 3.636 | 13 | 0,12 |
| Gerdau S.A. | 10.500 | 42 | 0,39 |
| Itau Unibanco Holding S.A. | 9.750 | 92 | 0,84 |
| Itausa - Investimentos Itau S.A. | 12.000 | 40 | 0,37 |
| Lenenergo PJSC | 700 | 1 | 0,01 |
| Lojas Americanas S.A. | 200 | 1 | 0,01 |
| Metalurgica Gerdau S.A. | 9.300 | 18 | 0,17 |
| Surgutneftegas PJSC | 74.000 | 50 | 0,46 |
| Transneft PJSC | 2 | $ 5 | 0,05 |
| | | 405 | 3,72 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | |
| Fibra Uno Administracion S.A. de C.V. | 12.100 | 16 | 0,15 |
| Growthpoint Properties Ltd. | 10.634 | 18 | 0,17 |
| Redefine Properties Ltd. | 12.611 | 8 | 0,07 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | 42 | 0,39 |
| **RECHTE** | | | |
| Enel Americas S.A. - Exp. 26.07.2019 | 18.979 | 0 | 0,00 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 10.759** | **98,86** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 10.759** | **98,86** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 124** | **1,14** |
| **Nettovermögen** | | **$ 10.883** | **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.**

**Bewertung zum Marktwert**[1]

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 4.182 | $ 6.577 | $ 0 | $ 10.759 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 2.900 | $ 6.905 | $ 0 | $ 9.805 |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 98,86 | 99,14 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Brasilien | 8,16 | 8,69 |
| Chile | 1,46 | 1,40 |
| China | 7,79 | 8,73 |
| Griechenland | 0,60 | 0,40 |
| Hongkong | 3,91 | 4,07 |
| Indien | 11,84 | 10,86 |
| Indonesien | 2,16 | 2,22 |
| Malaysia | 2,71 | 2,68 |
| Mexiko | 2,30 | 2,25 |
| Philippinen | 0,98 | 0,65 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Polen | 1,11 | 1,23 |
| Rumänien | 0,01 | 0,00 |
| Russland | 9,04 | 8,44 |
| Singapur | 0,03 | 0,03 |
| Südafrika | 5,69 | 5,28 |
| Südkorea | 18,33 | 17,99 |
| Taiwan | 13,61 | 15,01 |
| Thailand | 4,31 | 4,30 |
| Türkei | 0,59 | 0,50 |
| Ukraine | 0,01 | 0,01 |
| Großbritannien | 0,08 | 0,09 |
| Vereinigte Staaten | 0,03 | 0,00 |
| Vorzugswertpapiere | 3,72 | 3,92 |
| Real Estate Investment Trusts | 0,39 | 0,39 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 1,14 | 0,86 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **ÖSTERREICH** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telekom Austria AG | 675 | € 5 | 0,09 |
| **ENERGIE** | | | |
| OMV AG | 96 | 4 | 0,09 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe | 232 | 5 | 0,11 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Verbund AG | 109 | 5 | 0,11 |
| Summe Österreich | | 19 | 0,40 |
| **BELGIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Proximus SADP | 217 | 6 | 0,12 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Anheuser-Busch InBev S.A. NV | 276 | 21 | 0,45 |
| Colruyt S.A. | 186 | 10 | 0,21 |
| | | 31 | 0,66 |
| **ENERGIE** | | | |
| Euronav NV | 604 | 5 | 0,11 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Ageas | 331 | 15 | 0,32 |
| Gimv NV | 93 | 5 | 0,11 |
| | | 20 | 0,43 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| UCB S.A. | 99 | 7 | 0,16 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Umicore S.A. | 182 | 5 | 0,11 |
| Summe Belgien | | 74 | 1,59 |
| **DÄNEMARK** | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Carlsberg A/S 'B' | 84 | 10 | 0,21 |
| **ENERGIE** | | | |
| Drilling Co. of 1972 A/S (a) | 34 | 2 | 0,05 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Coloplast A/S 'B' | 59 | 6 | 0,13 |
| GN Store Nord A/S | 124 | 5 | 0,10 |
| Novo Nordisk A/S 'B' | 512 | 23 | 0,49 |
| | | 34 | 0,72 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| AP Moller - Maersk A/S 'B' | 17 | 19 | 0,40 |
| DSV A/S | 61 | 5 | 0,11 |
| ISS A/S | 145 | 4 | 0,08 |
| Vestas Wind Systems A/S | 65 | 5 | 0,11 |
| | | 33 | 0,70 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Chr Hansen Holding A/S | 52 | 4 | 0,09 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Orsted A/S | 72 | 6 | 0,12 |
| Summe Dänemark | | 89 | 1,89 |
| **FINNLAND** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Elisa Oyj | 119 | € 5 | 0,11 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Kesko Oyj 'B' | 153 | 8 | 0,16 |
| **ENERGIE** | | | |
| Neste Oyj | 414 | 12 | 0,26 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Sampo Oyj 'A' | 252 | 11 | 0,22 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Orion Oyj 'B' | 147 | 5 | 0,10 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Kone Oyj 'B' | 338 | 17 | 0,36 |
| Wartsila Oyj Abp | 292 | 4 | 0,09 |
| | | 21 | 0,45 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Nokia Oyj | 2.756 | 12 | 0,26 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Stora Enso Oyj 'R' | 501 | 5 | 0,11 |
| UPM-Kymmene Oyj | 168 | 4 | 0,09 |
| | | 9 | 0,20 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Fortum Oyj | 625 | 12 | 0,26 |
| Summe Finnland | | 95 | 2,02 |
| **FRANKREICH** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Lagardere S.C.A. | 268 | 6 | 0,13 |
| Orange S.A. | 2.103 | 29 | 0,62 |
| Publicis Groupe S.A. | 76 | 3 | 0,06 |
| Television Francaise | 491 | 5 | 0,11 |
| Vivendi S.A. | 1.360 | 33 | 0,71 |
| | | 76 | 1,63 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Cie Generale des Etablissements Michelin S.C.A. | 49 | 5 | 0,11 |
| Hermes International | 17 | 11 | 0,24 |
| Kering S.A. | 20 | 10 | 0,22 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 105 | 39 | 0,83 |
| Peugeot S.A. | 637 | 14 | 0,30 |
| Renault S.A. | 67 | 4 | 0,09 |
| Sodexo S.A. | 90 | 9 | 0,19 |
| | | 92 | 1,98 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Carrefour S.A. | 638 | 11 | 0,23 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 141 | 4 | 0,08 |
| Danone S.A. | 283 | 21 | 0,45 |
| L'Oreal S.A. | 106 | 27 | 0,58 |
| Pernod Ricard S.A. | 94 | 15 | 0,32 |
| | | 78 | 1,66 |
| **ENERGIE** | | | |
| Total S.A. | 1.006 | 50 | 1,06 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| AXA S.A. | 635 | 15 | 0,32 |
| Natixis S.A. | 871 | 3 | 0,06 |
| SCOR SE | 103 | 4 | 0,09 |
| Societe Generale S.A. | 133 | € 3 | 0,06 |
| | | 25 | 0,53 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Sanofi | 298 | 23 | 0,48 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Aeroports de Paris | 25 | 4 | 0,08 |
| Air France-KLM (a) | 439 | 4 | 0,08 |
| Airbus SE | 333 | 41 | 0,88 |
| Alstom S.A. | 194 | 8 | 0,17 |
| Bouygues S.A. | 136 | 4 | 0,09 |
| Bureau Veritas S.A. | 224 | 5 | 0,11 |
| Dassault Aviation S.A. | 3 | 4 | 0,09 |
| Legrand S.A. | 92 | 6 | 0,13 |
| Rexel S.A. | 420 | 5 | 0,11 |
| Safran S.A. | 160 | 21 | 0,45 |
| Societe BIC S.A. | 48 | 3 | 0,06 |
| Teleperformance | 30 | 5 | 0,11 |
| Thales S.A. | 73 | 8 | 0,17 |
| Vinci S.A. | 284 | 25 | 0,53 |
| | | 143 | 3,06 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Atos SE | 60 | 4 | 0,08 |
| Dassault Systemes SE | 56 | 8 | 0,17 |
| Worldline S.A. (a) | 24 | 2 | 0,04 |
| | | 14 | 0,29 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Air Liquide S.A. | 113 | 14 | 0,30 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Nexity S.A. | 102 | 4 | 0,08 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Electricite de France S.A. | 1.250 | 14 | 0,30 |
| Engie S.A. | 2.199 | 29 | 0,63 |
| Veolia Environnement S.A. | 626 | 13 | 0,28 |
| | | 56 | 1,21 |
| Summe Frankreich | | 575 | 12,28 |
| **DEUTSCHLAND** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Axel Springer SE | 75 | 5 | 0,11 |
| Deutsche Telekom AG | 1.277 | 20 | 0,43 |
| ProSiebenSat.1 Media SE | 245 | 3 | 0,06 |
| Scout24 AG | 26 | 1 | 0,02 |
| Telefonica Deutschland Holding AG | 1.290 | 3 | 0,06 |
| | | 32 | 0,68 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| adidas AG | 135 | 37 | 0,79 |
| Bayerische Motoren Werke AG | 164 | 11 | 0,23 |
| Continental AG | 65 | 8 | 0,17 |
| Daimler AG | 85 | 4 | 0,09 |
| Hugo Boss AG | 70 | 4 | 0,09 |
| Leoni AG | 150 | 2 | 0,04 |
| TUI AG | 299 | 3 | 0,06 |
| | | 69 | 1,47 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Beiersdorf AG | 53 | 5 | 0,11 |
| METRO AG | 301 | 5 | 0,11 |
| Suedzucker AG | 332 | 5 | 0,11 |
| | | 15 | 0,33 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **FINANZWERTE** | | | | |
| Commerzbank AG | 817 | € | 5 | 0,11 |
| Deutsche Bank AG | 1.214 | | 8 | 0,17 |
| Deutsche Börse AG | 144 | | 18 | 0,38 |
| Deutsche Pfandbriefbank AG | 381 | | 4 | 0,09 |
| Hannover Rueck SE | 62 | | 9 | 0,19 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 207 | | 46 | 0,98 |
| Talanx AG | 137 | | 5 | 0,11 |
| | | | 95 | 2,03 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | | |
| Carl Zeiss Meditec AG | 65 | | 5 | 0,11 |
| Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA | 228 | | 16 | 0,34 |
| Merck KGaA | 62 | | 6 | 0,13 |
| | | | 27 | 0,58 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Brenntag AG | 121 | | 5 | 0,11 |
| Deutsche Lufthansa AG | 549 | | 8 | 0,17 |
| Deutsche Post AG | 358 | | 11 | 0,24 |
| Hochtief AG | 31 | | 3 | 0,06 |
| Kloeckner & Co. SE | 598 | | 3 | 0,06 |
| MTU Aero Engines AG | 23 | | 5 | 0,11 |
| | | | 35 | 0,75 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | | |
| Infineon Technologies AG | 126 | | 2 | 0,04 |
| SAP SE | 647 | | 78 | 1,66 |
| Wirecard AG | 30 | | 5 | 0,10 |
| | | | 85 | 1,80 |
| **BAUSTOFFE** | | | | |
| Aurubis AG | 116 | | 5 | 0,11 |
| BASF SE | 392 | | 25 | 0,53 |
| Covestro AG | 76 | | 4 | 0,08 |
| Evonik Industries AG | 164 | | 4 | 0,09 |
| K+S AG | 261 | | 4 | 0,09 |
| Symrise AG | 61 | | 5 | 0,11 |
| | | | 47 | 1,01 |
| **IMMOBILIEN** | | | | |
| Deutsche Wohnen SE | 197 | | 6 | 0,13 |
| LEG Immobilien AG | 44 | | 5 | 0,10 |
| TAG Immobilien AG | 208 | | 4 | 0,08 |
| Vonovia SE | 475 | | 20 | 0,43 |
| | | | 35 | 0,74 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| E.ON SE | 1.895 | | 18 | 0,38 |
| Innogy SE | 290 | | 11 | 0,24 |
| RWE AG | 895 | | 19 | 0,41 |
| Uniper SE | 561 | | 15 | 0,32 |
| | | | 63 | 1,35 |
| Summe Deutschland | | | 503 | 10,74 |
| **IRLAND** | | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| Glanbia PLC | 278 | | 4 | 0,09 |
| Kerry Group PLC 'A' | 135 | | 14 | 0,30 |
| | | | 18 | 0,39 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | | |
| ICON PLC (a) | 37 | | 5 | 0,11 |
| Medtronic PLC | 1.010 | | 86 | 1,84 |
| | | | 91 | 1,95 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| DCC PLC | 63 | € | 5 | 0,10 |
| Kingspan Group PLC | 101 | | 5 | 0,11 |
| | | | 10 | 0,21 |
| **BAUSTOFFE** | | | | |
| James Hardie Industries PLC ADR | 393 | | 5 | 0,10 |
| Smurfit Kappa Group PLC | 225 | | 6 | 0,12 |
| | | | 11 | 0,22 |
| Summe Irland | | | 130 | 2,77 |
| **ITALIEN** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| Telecom Italia SpA | 11.561 | | 6 | 0,12 |
| **LUXUSGÜTER** | | | | |
| Ferrari NV | 45 | | 7 | 0,15 |
| Moncler SpA | 139 | | 5 | 0,10 |
| | | | 12 | 0,25 |
| **ENERGIE** | | | | |
| Eni SpA | 2.659 | | 39 | 0,83 |
| Saipem SpA (a) | 1.041 | | 5 | 0,11 |
| Saras SpA | 2.629 | | 3 | 0,06 |
| | | | 47 | 1,00 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| BPER Banca | 1.305 | | 5 | 0,10 |
| Societa Cattolica di Assicurazioni S.C. | 629 | | 5 | 0,11 |
| Unione di Banche Italiane SpA | 1.681 | | 4 | 0,08 |
| Unipol Gruppo Finanziario SpA | 1.172 | | 5 | 0,11 |
| | | | 19 | 0,40 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | | |
| DiaSorin SpA | 54 | | 5 | 0,12 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Atlantia SpA | 239 | | 5 | 0,12 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| Enel SpA | 6.320 | | 39 | 0,83 |
| ERG SpA | 261 | | 4 | 0,08 |
| Iren SpA | 2.157 | | 5 | 0,11 |
| Snam SpA | 2.230 | | 10 | 0,21 |
| Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | 2.449 | | 14 | 0,30 |
| | | | 72 | 1,53 |
| Summe Italien | | | 166 | 3,54 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| RTL Group S.A. | 83 | | 4 | 0,08 |
| SES S.A. | 512 | | 7 | 0,15 |
| | | | 11 | 0,23 |
| **BAUSTOFFE** | | | | |
| ArcelorMittal | 772 | | 12 | 0,26 |
| Summe Luxemburg | | | 23 | 0,49 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| Koninklijke KPN NV | 5.380 | | 14 | 0,31 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| Heineken Holding NV | 108 | | 10 | 0,21 |
| Heineken NV | 141 | | 14 | 0,30 |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV | 2.323 | | 46 | 0,98 |
| | | | 70 | 1,49 |
| **ENERGIE** | | | | |
| Fugro NV (a) | 410 | € | 3 | 0,06 |
| Royal Dutch Shell PLC 'A' | 2.702 | | 78 | 1,66 |
| | | | 81 | 1,72 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| Aegon NV | 2.112 | | 9 | 0,19 |
| ASR Nederland NV | 121 | | 4 | 0,08 |
| ING Groep NV | 1.606 | | 17 | 0,36 |
| NN Group NV | 362 | | 13 | 0,28 |
| | | | 43 | 0,91 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | | |
| Koninklijke Philips NV | 383 | | 15 | 0,32 |
| QIAGEN NV (a) | 146 | | 5 | 0,10 |
| | | | 20 | 0,42 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Boskalis Westminster | 177 | | 4 | 0,09 |
| Koninklijke BAM Groep NV | 329 | | 1 | 0,02 |
| Signify NV | 202 | | 5 | 0,11 |
| Wolters Kluwer NV | 211 | | 13 | 0,28 |
| | | | 23 | 0,50 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | | |
| ASML Holding NV | 73 | | 13 | 0,29 |
| **BAUSTOFFE** | | | | |
| Akzo Nobel NV | 256 | | 21 | 0,45 |
| Corbion NV | 167 | | 5 | 0,10 |
| Koninklijke DSM NV | 200 | | 22 | 0,47 |
| | | | 48 | 1,02 |
| Summe Niederlande | | | 312 | 6,66 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | | |
| Telenor ASA | 1.198 | | 22 | 0,48 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| Austevoll Seafood ASA | 336 | | 3 | 0,07 |
| Leroy Seafood Group ASA | 551 | | 3 | 0,06 |
| Marine Harvest ASA | 480 | | 10 | 0,21 |
| Orkla ASA | 580 | | 5 | 0,11 |
| Salmar ASA | 83 | | 3 | 0,06 |
| | | | 24 | 0,51 |
| **ENERGIE** | | | | |
| Aker BP ASA | 30 | | 1 | 0,02 |
| Equinor ASA | 1.260 | | 22 | 0,47 |
| PGS ASA | 1.934 | | 3 | 0,06 |
| TGS NOPEC Geophysical Co. ASA | 169 | | 4 | 0,08 |
| | | | 30 | 0,63 |
| **FINANZWERTE** | | | | |
| DNB ASA | 412 | | 7 | 0,15 |
| Gjensidige Forsikring ASA | 307 | | 5 | 0,11 |
| | | | 12 | 0,26 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| Tomra Systems ASA | 188 | | 5 | 0,12 |
| **BAUSTOFFE** | | | | |
| Yara International ASA | 399 | | 17 | 0,36 |
| Summe Norwegen | | | 110 | 2,36 |
| **PORTUGAL** | | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | | |
| Jeronimo Martins SGPS S.A. | 411 | | 6 | 0,13 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Navigator Co. S.A. | 1.105 | € 4 | 0,08 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| EDP - Energias de Portugal S.A. | 3.945 | 13 | 0,28 |
| Summe Portugal | | 23 | 0,49 |
| **SPANIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telefonica S.A. | 3.382 | 25 | 0,52 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Industria de Diseno Textil S.A. | 728 | 19 | 0,41 |
| **ENERGIE** | | | |
| Repsol S.A. | 2.079 | 29 | 0,61 |
| Banco Santander S.A. | 4.826 | 20 | 0,43 |
| Mapfre S.A. | 1.727 | 4 | 0,09 |
| | | 24 | 0,52 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Grifols S.A. | 268 | 7 | 0,15 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. | 318 | 11 | 0,24 |
| Aena SME S.A. | 63 | 11 | 0,23 |
| Cia de Distribucion Integral Logista Holdings S.A. | 215 | 4 | 0,09 |
| Ferrovial S.A. | 748 | 17 | 0,36 |
| Sacyr S.A. | 2.203 | 5 | 0,11 |
| | | 48 | 1,03 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Amadeus IT Group S.A. | 292 | 20 | 0,43 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Endesa S.A. | 1.197 | 27 | 0,58 |
| Iberdrola S.A. | 7.783 | 68 | 1,45 |
| Naturgy Energy Group S.A. | 937 | 23 | 0,49 |
| Red Electrica Corp. S.A. | 550 | 10 | 0,21 |
| | | 128 | 2,73 |
| Summe Spanien | | 300 | 6,40 |
| **SCHWEDEN** | | | |
| Tele2 AB 'B' | 1.725 | 22 | 0,47 |
| Telia Co. AB | 8.950 | 35 | 0,75 |
| | | 57 | 1,22 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Autoliv, Inc. | 166 | 10 | 0,21 |
| Electrolux AB 'B' | 255 | 6 | 0,13 |
| Hennes & Mauritz AB 'B' | 1.767 | 28 | 0,60 |
| JM AB | 267 | 5 | 0,11 |
| | | 49 | 1,05 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Axfood AB | 291 | 5 | 0,11 |
| Essity AB 'B' | 210 | 6 | 0,13 |
| ICA Gruppen AB | 138 | 5 | 0,11 |
| Swedish Match AB | 117 | 4 | 0,08 |
| | | 20 | 0,43 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Industrivarden AB 'C' | 244 | 5 | 0,11 |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | 514 | 4 | 0,09 |
| Svenska Handelsbanken AB 'A' | 643 | € 5 | 0,11 |
| Swedbank AB 'A' | 662 | 9 | 0,19 |
| | | 23 | 0,50 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Alfa Laval AB | 224 | 4 | 0,08 |
| Assa Abloy AB 'B' | 540 | 11 | 0,23 |
| Atlas Copco AB 'A' | 582 | 17 | 0,36 |
| S.A.S. AB (a) | 2.501 | 3 | 0,06 |
| Sandvik AB | 822 | 13 | 0,28 |
| Securitas AB 'B' | 357 | 6 | 0,13 |
| SKF AB 'B' | 324 | 5 | 0,11 |
| Volvo AB 'B' | 1.240 | 17 | 0,36 |
| | | 76 | 1,61 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | 9.194 | 77 | 1,64 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Castellum AB | 277 | 5 | 0,10 |
| Summe Schweden | | 307 | 6,55 |
| **SCHWEIZ** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Swisscom AG | 35 | 15 | 0,33 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Cie Financiere Richemont S.A. | 231 | 17 | 0,36 |
| Forbo Holding AG | 3 | 5 | 0,11 |
| Garmin Ltd. | 146 | 10 | 0,22 |
| | | 32 | 0,69 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG | 1 | 6 | 0,13 |
| Nestle S.A. | 1.545 | 141 | 3,01 |
| | | 147 | 3,14 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Baloise Holding AG | 65 | 10 | 0,21 |
| Cembra Money Bank AG | 61 | 5 | 0,11 |
| Helvetia Holding AG | 40 | 4 | 0,09 |
| Swiss Life Holding AG | 36 | 16 | 0,34 |
| Swiss Re AG | 767 | 69 | 1,47 |
| Zurich Insurance Group AG | 278 | 85 | 1,81 |
| | | 189 | 4,03 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Alcon, Inc. (a) | 98 | 5 | 0,11 |
| Lonza Group AG | 32 | 10 | 0,21 |
| Novartis AG | 492 | 40 | 0,85 |
| Roche Holding AG | 333 | 82 | 1,75 |
| Sonova Holding AG | 32 | 6 | 0,13 |
| Vifor Pharma AG | 38 | 5 | 0,11 |
| | | 148 | 3,16 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ABB Ltd. | 1.478 | 26 | 0,56 |
| Geberit AG | 13 | 5 | 0,11 |
| Kuehne + Nagel International AG | 57 | 8 | 0,17 |
| Schindler Holding AG | 45 | 9 | 0,19 |
| SGS S.A. | 5 | 11 | 0,23 |
| | | 59 | 1,26 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Logitech International S.A. | 143 | 5 | 0,11 |
| TE Connectivity Ltd. | 319 | 27 | 0,57 |
| | | 32 | 0,68 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Ferrexpo PLC | 1.857 | € 6 | 0,13 |
| Givaudan S.A. | 7 | 17 | 0,37 |
| Glencore PLC | 7.393 | 22 | 0,47 |
| Sika AG | 104 | 16 | 0,34 |
| | | 61 | 1,31 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| PSP Swiss Property AG | 52 | 5 | 0,10 |
| Swiss Prime Site AG | 61 | 5 | 0,11 |
| | | 10 | 0,21 |
| Summe Schweiz | | 693 | 14,81 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| BT Group PLC | 6.756 | 15 | 0,32 |
| Daily Mail & General Trust PLC | 294 | 3 | 0,06 |
| Euromoney Institutional Investor PLC | 109 | 2 | 0,04 |
| Informa PLC | 525 | 5 | 0,11 |
| Inmarsat PLC | 690 | 4 | 0,08 |
| ITV PLC | 2.653 | 3 | 0,06 |
| Pearson PLC | 2.350 | 21 | 0,45 |
| Vodafone Group PLC | 19.961 | 29 | 0,62 |
| | | 82 | 1,74 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Bellway PLC | 125 | 4 | 0,08 |
| Berkeley Group Holdings PLC | 105 | 4 | 0,08 |
| Burberry Group PLC | 216 | 5 | 0,11 |
| Compass Group PLC | 1.429 | 30 | 0,64 |
| Dixons Carphone PLC | 2.302 | 3 | 0,06 |
| Dunelm Group PLC | 430 | 4 | 0,08 |
| EI Group PLC (a) | 1.796 | 4 | 0,08 |
| Fiat Chrysler Automobiles NV | 328 | 4 | 0,08 |
| Greene King PLC | 775 | 5 | 0,11 |
| Greggs PLC | 317 | 8 | 0,17 |
| Halfords Group PLC | 1.886 | 5 | 0,11 |
| InterContinental Hotels Group PLC | 88 | 5 | 0,11 |
| JD Sports Fashion PLC | 928 | 6 | 0,13 |
| Kingfisher PLC | 5.469 | 13 | 0,28 |
| Marks & Spencer Group PLC | 4.023 | 10 | 0,21 |
| Moneysupermarket.com Group PLC | 1.325 | 6 | 0,13 |
| Next PLC | 170 | 11 | 0,23 |
| Sports Direct International PLC | 1.348 | 4 | 0,09 |
| SSP Group PLC | 521 | 4 | 0,09 |
| Taylor Wimpey PLC | 1.352 | 2 | 0,04 |
| WH Smith PLC | 187 | 4 | 0,09 |
| Whitbread PLC | 83 | 4 | 0,09 |
| William Hill PLC | 2.054 | 4 | 0,09 |
| | | 149 | 3,18 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Associated British Foods PLC | 152 | 4 | 0,08 |
| British American Tobacco PLC | 302 | 9 | 0,19 |
| Britvic PLC | 468 | 5 | 0,11 |
| Diageo PLC | 1.817 | 69 | 1,47 |
| Imperial Brands PLC | 989 | 21 | 0,45 |
| J Sainsbury PLC | 4.708 | 10 | 0,21 |
| Reckitt Benckiser Group PLC | 415 | 29 | 0,62 |
| Tate & Lyle PLC | 835 | 7 | 0,15 |
| Tesco PLC | 6.708 | 17 | 0,36 |
| Unilever NV | 567 | 30 | 0,64 |
| Unilever PLC | 345 | 19 | 0,41 |
| WM Morrison Supermarkets PLC | 5.444 | 12 | 0,26 |
| | | 232 | 4,95 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ENERGIE** | | | |
| BP PLC | 6.204 | € 38 | 0,81 |
| Hunting PLC | 602 | 4 | 0,09 |
| John Wood Group PLC | 606 | 3 | 0,06 |
| Petrofac Ltd. | 713 | 3 | 0,06 |
| Tullow Oil PLC | 1.634 | 4 | 0,09 |
| | | 52 | 1,11 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| 3i Group PLC | 771 | 10 | 0,21 |
| Admiral Group PLC | 330 | 8 | 0,17 |
| Barclays PLC | 8.323 | 14 | 0,30 |
| Direct Line Insurance Group PLC | 3.096 | 12 | 0,26 |
| Hargreaves Lansdown PLC | 202 | 4 | 0,08 |
| HSBC Holdings PLC | 1.745 | 13 | 0,28 |
| IG Group Holdings PLC | 639 | 4 | 0,09 |
| Jupiter Fund Management PLC | 1.156 | 5 | 0,11 |
| Lancashire Holdings Ltd. | 638 | 5 | 0,11 |
| Legal & General Group PLC | 2.425 | 7 | 0,15 |
| London Stock Exchange Group PLC | 121 | 7 | 0,15 |
| Provident Financial PLC | 698 | 3 | 0,06 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC | 1.550 | 4 | 0,09 |
| RSA Insurance Group PLC | 755 | 5 | 0,11 |
| Standard Chartered PLC | 1.252 | 10 | 0,21 |
| | | 111 | 2,38 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| AstraZeneca PLC | 609 | 44 | 0,94 |
| GlaxoSmithKline PLC | 5.165 | 91 | 1,94 |
| Smith & Nephew PLC | 632 | 12 | 0,26 |
| | | 147 | 3,14 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Aggreko PLC | 497 | 4 | 0,08 |
| Ashtead Group PLC | 77 | 2 | 0,04 |
| BAE Systems PLC | 1.571 | 9 | 0,19 |
| Balfour Beatty PLC | 1.404 | 4 | 0,08 |
| Bunzl PLC | 167 | 4 | 0,08 |
| CNH Industrial NV | 493 | 4 | 0,08 |
| easyJet PLC | 443 | 5 | 0,11 |
| Experian PLC | 439 | 12 | 0,26 |
| Ferguson PLC | 76 | € 5 | 0,11 |
| Go-Ahead Group PLC | 187 | 4 | 0,08 |
| HomeServe PLC | 404 | 5 | 0,11 |
| Howden Joinery Group PLC | 801 | 5 | 0,11 |
| IMI PLC | 521 | 6 | 0,13 |
| International Consolidated Airlines Group S.A. | 659 | 4 | 0,08 |
| Morgan Advanced Materials PLC | 1.408 | 4 | 0,09 |
| Pagegroup PLC | 785 | 5 | 0,11 |
| QinetiQ Group PLC | 1.421 | 4 | 0,09 |
| RELX PLC | 1.171 | 25 | 0,53 |
| Rentokil Initial PLC | 2.234 | 10 | 0,21 |
| Rolls-Royce Holdings PLC | 643 | 6 | 0,13 |
| Royal Mail PLC | 2.932 | 7 | 0,15 |
| Senior PLC | 1.523 | 4 | 0,09 |
| Spirax-Sarco Engineering PLC | 58 | 6 | 0,13 |
| Stagecoach Group PLC | 2.465 | 3 | 0,06 |
| Travis Perkins PLC | 360 | 5 | 0,11 |
| Vesuvius PLC | 724 | 4 | 0,09 |
| | | 156 | 3,33 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Computacenter PLC | 340 | 5 | 0,11 |
| Halma PLC | 228 | 5 | 0,11 |
| Micro Focus International PLC | 156 | 4 | 0,08 |
| Sage Group PLC | 700 | 6 | 0,13 |
| | | 20 | 0,43 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Anglo American PLC | 779 | 20 | 0,43 |
| BHP Group PLC | 1.669 | 37 | 0,79 |
| Croda International PLC | 106 | 6 | 0,13 |
| Johnson Matthey PLC | 208 | 8 | 0,17 |
| Rio Tinto PLC | 478 | 26 | 0,56 |
| Victrex PLC | 144 | 3 | 0,07 |
| | | 100 | 2,15 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Centrica PLC | 10.737 | 11 | 0,23 |
| Drax Group PLC | 932 | 3 | 0,06 |
| National Grid PLC | 4.410 | 41 | 0,88 |
| Pennon Group PLC | 509 | € 4 | 0,08 |
| Severn Trent PLC | 198 | 5 | 0,11 |
| SSE PLC | 1.704 | 21 | 0,45 |
| Telecom Plus PLC | 319 | 5 | 0,11 |
| United Utilities Group PLC | 502 | 4 | 0,09 |
| | | 94 | 2,01 |
| Summe Großbritannien | | 1.143 | 24,42 |
| **USA** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Carnival PLC | 86 | 3 | 0,07 |
| Summe Stammaktien | | 4.565 | 97,48 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Henkel AG & Co. KGaA | 105 | 9 | 0,19 |
| Volkswagen AG | 186 | 28 | 0,59 |
| | | 37 | 0,78 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | |
| British Land Co. PLC | 724 | 4 | 0,08 |
| Covivio | 50 | 5 | 0,11 |
| Derwent London PLC | 124 | 4 | 0,08 |
| Gecina S.A. | 41 | 5 | 0,11 |
| Klepierre S.A. | 247 | 7 | 0,15 |
| Land Securities Group PLC | 619 | 6 | 0,13 |
| Segro PLC | 606 | 5 | 0,11 |
| Shaftesbury PLC | 419 | 4 | 0,09 |
| UNITE Group PLC | 438 | 5 | 0,11 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | 45 | 0,97 |
| **RECHTE** | | | |
| Repsol S.A. - Exp. 07.09.2019 | 2.079 | 1 | 0,03 |
| | | 1 | 0,03 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **€ 4.648** | **99,26** |
| **Summe Anlagen** | | **€ 4.648** | **99,26** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **€ 35** | **0,74** |
| **Nettovermögen** | | **€ 4.683** | **100,00** |

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

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

**(a) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 367 | € 4.281 | € 0 | € 4.648 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | € 177 | € 3.898 | € 0 | € 4.075 |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 99,26 | 99,28 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Österreich | 0,40 | 0,39 |
| Belgien | 1,59 | 1,61 |
| Dänemark | 1,89 | 1,95 |
| Finnland | 2,02 | 2,22 |
| Frankreich | 12,28 | 12,87 |
| Deutschland | 10,74 | 10,25 |
| Irland | 2,77 | 2,74 |
| Italien | 3,54 | 3,37 |
| Luxemburg | 0,49 | 0,64 |
| Niederlande | 6,66 | 7,29 |
| Norwegen | 2,36 | 2,56 |
| Portugal | 0,49 | 0,50 |
| Spanien | 6,40 | 5,62 |
| Schweden | 6,55 | 6,60 |
| Schweiz | 14,81 | 13,14 |
| Großbritannien | 24,42 | 24,98 |
| Vereinigte Staaten | 0,07 | 0,34 |
| Vorzugswertpapiere | 0,78 | 0,98 |
| Real Estate Investment Trusts | 0,97 | 1,21 |
| Bezugsrechte | 0,03 | 0,02 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,74 | 0,72 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| SEEK Ltd. | 389 | $ 6 | 0,12 |
| Telstra Corp. Ltd. | 3.881 | 10 | 0,19 |
| | | 16 | 0,31 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Wesfarmers Ltd. | 269 | 7 | 0,13 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Coca-Cola Amatil Ltd. | 667 | 5 | 0,10 |
| Woolworths Group Ltd. | 405 | 9 | 0,17 |
| | | 14 | 0,27 |
| **ENERGIE** | | | |
| Caltex Australia Ltd. | 257 | 5 | 0,10 |
| Woodside Petroleum Ltd. | 213 | 5 | 0,09 |
| | | 10 | 0,19 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| AMP Ltd. | 2.759 | 4 | 0,08 |
| Insurance Australia Group Ltd. | 988 | 6 | 0,11 |
| Macquarie Group Ltd. | 59 | 5 | 0,10 |
| Medibank Pvt Ltd. | 2.528 | 6 | 0,11 |
| QBE Insurance Group Ltd. | 613 | 5 | 0,10 |
| Suncorp Group Ltd. | 511 | 5 | 0,09 |
| | | 31 | 0,59 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Ansell Ltd. | 302 | 6 | 0,11 |
| CSL Ltd. | 73 | 11 | 0,20 |
| | | 17 | 0,31 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Brambles Ltd. | 661 | 6 | 0,11 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| BHP Group Ltd. | 457 | 13 | 0,25 |
| Newcrest Mining Ltd. | 395 | 9 | 0,17 |
| | | 22 | 0,42 |
| Summe Australien | | 123 | 2,33 |
| **ÖSTERREICH** | | | |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe | 181 | 5 | 0,09 |
| **BELGIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Proximus SADP | 188 | 6 | 0,11 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Anheuser-Busch InBev S.A. NV | 70 | 6 | 0,12 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Ageas | 100 | 5 | 0,10 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| UCB S.A. | 57 | 5 | 0,09 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Umicore S.A. | 106 | 3 | 0,06 |
| Summe Belgien | | 25 | 0,48 |
| **KANADA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| BCE, Inc. | 146 | $ 6 | 0,11 |
| Quebecor, Inc. 'B' | 208 | 5 | 0,10 |
| Rogers Communications, Inc. 'B' | 94 | 5 | 0,10 |
| TELUS Corp. | 86 | 3 | 0,06 |
| Thomson Reuters Corp. | 104 | 7 | 0,13 |
| | | 26 | 0,50 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Canadian Tire Corp. Ltd. 'A' | 43 | 5 | 0,10 |
| Dollarama, Inc. | 187 | 7 | 0,13 |
| Gildan Activewear, Inc. | 140 | 5 | 0,10 |
| Lululemon Athletica, Inc. (a) | 35 | 6 | 0,11 |
| Magna International, Inc. | 223 | 11 | 0,21 |
| | | 34 | 0,65 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Alimentation Couche-Tard, Inc. 'B' | 98 | 6 | 0,11 |
| George Weston Ltd. | 90 | 7 | 0,13 |
| Loblaw Cos. Ltd. | 125 | 6 | 0,11 |
| Metro, Inc. | 153 | 6 | 0,11 |
| North West Co., Inc. | 231 | 5 | 0,10 |
| Rogers Sugar, Inc. | 1.100 | 5 | 0,10 |
| Saputo, Inc. | 168 | 5 | 0,10 |
| | | 40 | 0,76 |
| **ENERGIE** | | | |
| Cenovus Energy, Inc. | 583 | 5 | 0,09 |
| Enbridge, Inc. | 137 | 5 | 0,09 |
| Husky Energy, Inc. | 372 | 4 | 0,08 |
| | | 14 | 0,26 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bank of Montreal | 67 | 5 | 0,10 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | 58 | 5 | 0,10 |
| CI Financial Corp. | 323 | 5 | 0,10 |
| Fairfax Financial Holdings Ltd. | 11 | 6 | 0,11 |
| Power Corp. of Canada | 244 | 5 | 0,09 |
| Toronto-Dominion Bank | 91 | 5 | 0,09 |
| | | 31 | 0,59 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Canadian National Railway Co. | 126 | 12 | 0,23 |
| Canadian Pacific Railway Ltd. | 30 | 7 | 0,13 |
| Russel Metals, Inc. | 260 | 4 | 0,07 |
| TFI International, Inc. | 150 | 5 | 0,09 |
| | | 28 | 0,52 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| CGI, Inc. (a) | 81 | 6 | 0,11 |
| Constellation Software, Inc. | 7 | 7 | 0,13 |
| | | 13 | 0,24 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Barrick Gold Corp. | 351 | 6 | 0,11 |
| Eldorado Gold Corp. (a) | 1.435 | 8 | 0,15 |
| | | 14 | 0,26 |
| Summe Kanada | | 200 | 3,78 |
| **DÄNEMARK** | | | |
| **ENERGIE** | | | |
| Drilling Co. of 1972 A/S (a) | 10 | 1 | 0,01 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Novo Nordisk A/S 'B' | 154 | 8 | 0,15 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| AP Moller - Maersk A/S 'B' | 5 | $ 6 | 0,11 |
| ISS A/S | 145 | 5 | 0,10 |
| Vestas Wind Systems A/S | 61 | 5 | 0,09 |
| | | 16 | 0,30 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Orsted A/S | 66 | 5 | 0,11 |
| Summe Dänemark | | 30 | 0,57 |
| **FINNLAND** | | | |
| **ENERGIE** | | | |
| Neste Oyj | 186 | 7 | 0,12 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Sampo Oyj 'A' | 107 | 5 | 0,10 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Kone Oyj 'B' | 101 | 6 | 0,11 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Nokia Oyj | 866 | 4 | 0,08 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Stora Enso Oyj 'R' | 359 | 4 | 0,08 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Fortum Oyj | 234 | 5 | 0,10 |
| Summe Finnland | | 31 | 0,59 |
| **FRANKREICH** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Lagardere S.C.A. | 174 | 5 | 0,09 |
| Orange S.A. | 587 | 9 | 0,17 |
| Publicis Groupe S.A. | 85 | 5 | 0,09 |
| Vivendi S.A. | 446 | 12 | 0,23 |
| | | 31 | 0,58 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Hermes International | 9 | 6 | 0,11 |
| Kering S.A. | 11 | 7 | 0,13 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 26 | 11 | 0,21 |
| Peugeot S.A. | 212 | 5 | 0,10 |
| Sodexo S.A. | 47 | 6 | 0,11 |
| | | 35 | 0,66 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Carrefour S.A. | 254 | 5 | 0,10 |
| Danone S.A. | 34 | 3 | 0,06 |
| L'Oreal S.A. | 22 | 6 | 0,11 |
| Pernod Ricard S.A. | 32 | 6 | 0,11 |
| | | 20 | 0,38 |
| **ENERGIE** | | | |
| Total S.A. | 266 | 15 | 0,28 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| AXA S.A. | 198 | 5 | 0,10 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Sanofi | 103 | 9 | 0,17 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Airbus SE | 85 | 12 | 0,23 |
| Alstom S.A. | 113 | 5 | 0,10 |
| Bouygues S.A. | 136 | 5 | 0,10 |
| Rexel S.A. | 420 | 5 | 0,09 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Safran S.A. | 40 | $ 6 | 0,11 |
| Thales S.A. | 39 | 5 | 0,09 |
| Vinci S.A. | 77 | 8 | 0,15 |
| | | 46 | 0,87 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Dassault Systemes SE | 41 | 6 | 0,12 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Air Liquide S.A. | 42 | 6 | 0,11 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Electricite de France S.A. | 308 | 4 | 0,08 |
| Engie S.A. | 503 | 7 | 0,13 |
| Veolia Environnement S.A. | 238 | 6 | 0,12 |
| | | 17 | 0,33 |
| Summe Frankreich | | 190 | 3,60 |
| **DEUTSCHLAND** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Deutsche Telekom AG | 390 | 7 | 0,13 |
| ProSiebenSat.1 Media SE | 328 | 5 | 0,10 |
| | | 12 | 0,23 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| adidas AG | 34 | 11 | 0,21 |
| Bayerische Motoren Werke AG | 59 | 4 | 0,08 |
| Continental AG | 31 | 4 | 0,08 |
| | | 19 | 0,37 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Commerzbank AG | 528 | 4 | 0,08 |
| Deutsche Bank AG | 506 | 4 | 0,08 |
| Deutsche Börse AG | 42 | 6 | 0,11 |
| Hannover Rueck SE | 35 | 5 | 0,10 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 60 | 15 | 0,28 |
| | | 34 | 0,65 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA | 84 | 7 | 0,12 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Brenntag AG | 101 | 5 | 0,09 |
| Deutsche Lufthansa AG | 216 | 4 | 0,08 |
| Deutsche Post AG | 155 | 5 | 0,09 |
| | | 14 | 0,26 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Infineon Technologies AG | 249 | 5 | 0,09 |
| SAP SE | 184 | 25 | 0,47 |
| | | 30 | 0,56 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Aurubis AG | 83 | 4 | 0,07 |
| BASF SE | 94 | 7 | 0,13 |
| Salzgitter AG | 132 | 4 | 0,08 |
| | | 15 | 0,28 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Deutsche Wohnen SE | 104 | 4 | 0,08 |
| Vonovia SE | 104 | 5 | 0,09 |
| | | 9 | 0,17 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| E.ON SE | 493 | 5 | 0,10 |
| RWE AG | 236 | 6 | 0,11 |
| Uniper SE | 175 | $ 5 | 0,10 |
| | | 16 | 0,31 |
| Summe Deutschland | | 156 | 2,95 |
| **HONGKONG** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| HKT Trust & HKT Ltd. | 3.000 | 5 | 0,09 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Hongkong Land Holdings Ltd. | 800 | 5 | 0,10 |
| New World Development Co. Ltd. | 3.000 | 5 | 0,09 |
| Swire Pacific Ltd. 'A' | 500 | 6 | 0,11 |
| | | 16 | 0,30 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| China Gas Holdings Ltd. | 1.400 | 5 | 0,10 |
| CLP Holdings Ltd. | 500 | 5 | 0,10 |
| Hong Kong & China Gas Co. Ltd. | 2.200 | 5 | 0,10 |
| | | 15 | 0,30 |
| Summe Hongkong | | 36 | 0,69 |
| **IRLAND** | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Kerry Group PLC 'A' | 54 | 6 | 0,12 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| ICON PLC (a) | 37 | 6 | 0,11 |
| Medtronic PLC | 280 | 27 | 0,51 |
| | | 33 | 0,62 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Accenture PLC 'A' | 31 | 6 | 0,11 |
| Summe Irland | | 45 | 0,85 |
| **ISRAEL** | | | |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Bank Hapoalim BM | 748 | 6 | 0,11 |
| Bank Leumi Le-Israel BM | 771 | 6 | 0,11 |
| Israel Discount Bank Ltd. 'A' | 1.599 | 6 | 0,11 |
| | | 18 | 0,33 |
| Summe Israel | | 18 | 0,33 |
| **ITALIEN** | | | |
| **ENERGIE** | | | |
| Eni SpA | 685 | 12 | 0,21 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Societa Cattolica di Assicurazioni S.C. | 520 | 4 | 0,08 |
| Unipol Gruppo Finanziario SpA | 1.172 | 6 | 0,12 |
| | | 10 | 0,20 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Enel SpA | 2.215 | 15 | 0,29 |
| Snam SpA | 1.146 | 6 | 0,11 |
| Terna Rete Elettrica Nazionale SpA | 901 | 6 | 0,11 |
| | | 27 | 0,51 |
| Summe Italien | | 49 | 0,92 |
| **JAPAN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| KDDI Corp. | 500 | 13 | 0,25 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp. | 200 | 9 | 0,17 |
| NTT DOCOMO, Inc. | 400 | 9 | 0,17 |
| SoftBank Group Corp. | 200 | 10 | 0,19 |
| | | 41 | 0,78 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Bandai Namco Holdings, Inc. | 100 | $ 5 | 0,09 |
| Bridgestone Corp. | 200 | 8 | 0,15 |
| Honda Motor Co. Ltd. | 300 | 8 | 0,15 |
| Isuzu Motors Ltd. | 400 | 5 | 0,09 |
| Nikon Corp. | 300 | 4 | 0,07 |
| Nissan Motor Co. Ltd. | 800 | 6 | 0,11 |
| Oriental Land Co. Ltd. | 100 | 12 | 0,23 |
| Panasonic Corp. | 500 | 4 | 0,08 |
| Sony Corp. | 200 | 11 | 0,21 |
| Sumitomo Electric Industries Ltd. | 300 | 4 | 0,08 |
| Suzuki Motor Corp. | 100 | 5 | 0,09 |
| Takashimaya Co. Ltd. | 300 | 3 | 0,06 |
| Toyota Motor Corp. | 200 | 12 | 0,23 |
| Xebio Holdings Co. Ltd. | 400 | 5 | 0,09 |
| Yamada Denki Co. Ltd. | 1.000 | 4 | 0,08 |
| | | 96 | 1,81 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Aeon Co. Ltd. | 400 | 7 | 0,13 |
| Ajinomoto Co., Inc. | 300 | 5 | 0,10 |
| Asahi Group Holdings Ltd. | 100 | 5 | 0,09 |
| Japan Tobacco, Inc. | 400 | 9 | 0,17 |
| Kao Corp. | 100 | 8 | 0,15 |
| Kikkoman Corp. | 100 | 4 | 0,08 |
| Kirin Holdings Co. Ltd. | 200 | 4 | 0,08 |
| Maruha Nichiro Corp. | 100 | 3 | 0,06 |
| Ministop Co. Ltd. | 300 | 4 | 0,08 |
| Seven & i Holdings Co. Ltd. | 100 | 3 | 0,06 |
| Unicharm Corp. | 200 | 6 | 0,11 |
| | | 58 | 1,11 |
| **ENERGIE** | | | |
| Idemitsu Kosan Co. Ltd. | 323 | 10 | 0,19 |
| Inpex Corp. | 500 | 5 | 0,09 |
| JXTG Holdings, Inc. | 1.300 | 6 | 0,11 |
| | | 21 | 0,39 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Dai-ichi Life Holdings, Inc. | 200 | 3 | 0,06 |
| Japan Post Bank Co. Ltd. | 500 | 5 | 0,10 |
| Japan Post Holdings Co. Ltd. | 900 | 10 | 0,19 |
| Tokio Marine Holdings, Inc. | 100 | 5 | 0,09 |
| | | 23 | 0,44 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Alfresa Holdings Corp. | 200 | 5 | 0,10 |
| Astellas Pharma, Inc. | 500 | 7 | 0,13 |
| Daiichi Sankyo Co. Ltd. | 100 | 5 | 0,10 |
| Eisai Co. Ltd. | 100 | 6 | 0,11 |
| Hoya Corp. | 100 | 8 | 0,15 |
| Olympus Corp. | 400 | 4 | 0,08 |
| Otsuka Holdings Co. Ltd. | 100 | 3 | 0,06 |
| Santen Pharmaceutical Co. Ltd. | 300 | 5 | 0,10 |
| Sawai Pharmaceutical Co. Ltd. | 100 | 5 | 0,09 |
| Shionogi & Co. Ltd. | 100 | 6 | 0,11 |
| Sumitomo Dainippon Pharma Co. Ltd. | 100 | 2 | 0,04 |
| Suzuken Co. Ltd. | 100 | 6 | 0,11 |
| Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. | 169 | 6 | 0,11 |
| Terumo Corp. | 200 | 6 | 0,11 |
| Toho Holdings Co. Ltd. | 200 | 5 | 0,09 |
| | | 79 | 1,49 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ANA Holdings, Inc. | 100 | 3 | 0,06 |
| Daikin Industries Ltd. | 100 | 13 | 0,25 |
| East Japan Railway Co. | 100 | 9 | 0,17 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Fukuyama Transporting Co. Ltd. | 100 | $ 4 | 0,07 |
| Hankyu Hanshin Holdings, Inc. | 100 | 4 | 0,08 |
| Inaba Denki Sangyo Co. Ltd. | 100 | 4 | 0,08 |
| Japan Airlines Co. Ltd. | 100 | 3 | 0,06 |
| Keihan Holdings Co. Ltd. | 100 | 4 | 0,08 |
| Kintetsu Group Holdings Co. Ltd. | 100 | 5 | 0,09 |
| Komatsu Ltd. | 200 | 5 | 0,09 |
| Makita Corp. | 100 | 3 | 0,06 |
| Marubeni Corp. | 700 | 5 | 0,09 |
| Mitsubishi Corp. | 200 | 5 | 0,09 |
| Mitsubishi Heavy Industries Ltd. | 100 | 4 | 0,08 |
| Mitsui & Co. Ltd. | 500 | 8 | 0,15 |
| Nagase & Co. Ltd. | 300 | 5 | 0,09 |
| Nippon Yusen KK | 300 | 5 | 0,09 |
| Obayashi Corp. | 500 | 5 | 0,09 |
| Pilot Corp. | 100 | 4 | 0,08 |
| Recruit Holdings Co. Ltd. | 200 | 7 | 0,13 |
| Sojitz Corp. | 1.400 | 4 | 0,08 |
| Sotetsu Holdings, Inc. | 200 | 6 | 0,11 |
| Taisei Corp. | 100 | 4 | 0,08 |
| Toshiba Corp. | 100 | 3 | 0,06 |
| Toyota Tsusho Corp. | 100 | 3 | 0,06 |
| West Japan Railway Co. | 100 | 8 | 0,15 |
| | | 133 | 2,52 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Avex, Inc. | 300 | 4 | 0,08 |
| Canon, Inc. | 200 | 6 | 0,11 |
| Fujitsu Ltd. | 100 | 7 | 0,13 |
| Hitachi Ltd. | 300 | 11 | 0,21 |
| Konica Minolta, Inc. | 600 | 6 | 0,11 |
| Murata Manufacturing Co. Ltd. | 300 | 14 | 0,26 |
| NEC Corp. | 200 | 8 | 0,15 |
| Omron Corp. | 100 | 5 | 0,09 |
| Ricoh Co. Ltd. | 500 | 5 | 0,09 |
| Toho Co. Ltd. | 100 | 4 | 0,08 |
| | | 70 | 1,31 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| JFE Holdings, Inc. | 300 | 4 | 0,08 |
| Nihon Parkerizing Co. Ltd. | 400 | 4 | 0,08 |
| Nippon Steel Corp. | 400 | 7 | 0,13 |
| Oji Holdings Corp. | 1.000 | 6 | 0,11 |
| Toray Industries, Inc. | 600 | 5 | 0,09 |
| Toyo Ink SC Holdings Co. Ltd. | 200 | 4 | 0,08 |
| Toyo Seikan Group Holdings Ltd. | 200 | 4 | 0,08 |
| | | 34 | 0,65 |
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Mitsui Fudosan Co. Ltd. | 200 | 5 | 0,09 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Chubu Electric Power Co., Inc. | 400 | 6 | 0,11 |
| Osaka Gas Co. Ltd. | 200 | 3 | 0,06 |
| Toho Gas Co. Ltd. | 100 | 4 | 0,08 |
| Tokyo Electric Power Co. Holdings, Inc. (a) | 1.400 | 7 | 0,13 |
| Tokyo Gas Co. Ltd. | 200 | 5 | 0,09 |
| | | 25 | 0,47 |
| Summe Japan | | 585 | 11,06 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Amcor PLC (a) | 530 | 6 | 0,12 |
| **LUXEMBURG** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| SES S.A. | 238 | 4 | 0,07 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| ArcelorMittal | 231 | $ 4 | 0,08 |
| Summe Luxemburg | | 8 | 0,15 |
| **MACAU** | | | |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Sands China Ltd. | 1.200 | 6 | 0,11 |
| **NIEDERLANDE** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Koninklijke KPN NV | 1.817 | 5 | 0,10 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Heineken Holding NV | 57 | 6 | 0,12 |
| Heineken NV | 55 | 6 | 0,11 |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV | 679 | 15 | 0,29 |
| | | 27 | 0,52 |
| **ENERGIE** | | | |
| Royal Dutch Shell PLC 'A' | 727 | 24 | 0,45 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Aegon NV | 809 | 4 | 0,08 |
| ING Groep NV | 441 | 5 | 0,09 |
| NN Group NV | 117 | 5 | 0,09 |
| | | 14 | 0,26 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Koninklijke Philips NV | 133 | 6 | 0,11 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Wolters Kluwer NV | 85 | 6 | 0,12 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| ASML Holding NV | 37 | 8 | 0,15 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Akzo Nobel NV | 52 | 5 | 0,09 |
| Koninklijke DSM NV | 56 | 7 | 0,13 |
| | | 12 | 0,22 |
| Summe Niederlande | | 102 | 1,93 |
| **NEUSEELAND** | | | |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Ryman Healthcare Ltd. | 624 | 5 | 0,09 |
| **NORWEGEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telenor ASA | 263 | 6 | 0,11 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Austevoll Seafood ASA | 336 | 3 | 0,06 |
| Marine Harvest ASA | 216 | 5 | 0,10 |
| | | 8 | 0,16 |
| **ENERGIE** | | | |
| Aker Solutions ASA (a) | 841 | 3 | 0,06 |
| Equinor ASA | 389 | 8 | 0,15 |
| | | 11 | 0,21 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Yara International ASA | 120 | 6 | 0,11 |
| Summe Norwegen | | 31 | 0,59 |
| **PORTUGAL** | | | |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| EDP - Energias de Portugal S.A. | 1.616 | 6 | 0,12 |
| **SINGAPUR** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Singapore Telecommunications Ltd. | 2.200 | 6 | 0,11 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| United Overseas Bank Ltd. | 300 | $ 6 | 0,11 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ComfortDelGro Corp. Ltd. | 3.100 | 6 | 0,11 |
| Keppel Corp. Ltd. | 1.100 | 5 | 0,10 |
| Singapore Airlines Ltd. | 800 | 6 | 0,11 |
| | | 17 | 0,32 |
| Summe Singapur | | 29 | 0,54 |
| **SPANIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Telefonica S.A. | 590 | 5 | 0,09 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Industria de Diseno Textil S.A. | 172 | 5 | 0,10 |
| **ENERGIE** | | | |
| Repsol S.A. | 513 | 8 | 0,15 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Banco Santander S.A. | 1.033 | 5 | 0,09 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Grifols S.A. | 170 | 5 | 0,09 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. | 128 | 5 | 0,10 |
| Aena SME S.A. | 32 | 6 | 0,11 |
| Ferrovial S.A. | 252 | 7 | 0,13 |
| | | 18 | 0,34 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Amadeus IT Group S.A. | 86 | 7 | 0,13 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Endesa S.A. | 264 | 7 | 0,13 |
| Iberdrola S.A. | 2.079 | 20 | 0,38 |
| Naturgy Energy Group S.A. | 223 | 6 | 0,12 |
| Red Electrica Corp. S.A. | 227 | 5 | 0,10 |
| | | 38 | 0,73 |
| Summe Spanien | | 91 | 1,72 |
| **SCHWEDEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Tele2 AB 'B' | 443 | 6 | 0,12 |
| Telia Co. AB | 1.717 | 8 | 0,15 |
| | | 14 | 0,27 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Autoliv, Inc. | 59 | 4 | 0,08 |
| Electrolux AB 'B' | 241 | 6 | 0,11 |
| Hennes & Mauritz AB 'B' | 419 | 8 | 0,15 |
| | | 18 | 0,34 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Swedbank AB 'A' | 334 | 5 | 0,09 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Atlas Copco AB 'A' | 214 | 7 | 0,13 |
| Sandvik AB | 384 | 7 | 0,13 |
| SKF AB 'B' | 324 | 6 | 0,12 |
| Volvo AB 'B' | 349 | 5 | 0,10 |
| | | 25 | 0,48 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B' | 2.318 | 22 | 0,42 |
| Summe Schweden | | 84 | 1,60 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **SCHWEIZ** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| Swisscom AG | 11 | $ 6 | 0,10 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Cie Financiere Richemont S.A. | 74 | 6 | 0,12 |
| Garmin Ltd. | 78 | 6 | 0,12 |
| | | 12 | 0,24 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Nestle S.A. | 455 | 47 | 0,89 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Chubb Ltd. | 39 | 6 | 0,12 |
| Swiss Life Holding AG | 13 | 6 | 0,11 |
| Swiss Re AG | 166 | 17 | 0,32 |
| Zurich Insurance Group AG | 63 | 22 | 0,42 |
| | | 51 | 0,97 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Alcon, Inc. (a) | 28 | 2 | 0,04 |
| Lonza Group AG | 17 | 6 | 0,11 |
| Novartis AG | 142 | 13 | 0,25 |
| Roche Holding AG | 87 | 24 | 0,45 |
| | | 45 | 0,85 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ABB Ltd. | 510 | 10 | 0,19 |
| Kuehne + Nagel International AG | 38 | 6 | 0,11 |
| Schindler Holding AG | 24 | 5 | 0,10 |
| SFS Group AG | 53 | 5 | 0,09 |
| SGS S.A. | 2 | 5 | 0,09 |
| | | 31 | 0,58 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| TE Connectivity Ltd. | 70 | 7 | 0,13 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Givaudan S.A. | 2 | 5 | 0,10 |
| Glencore PLC | 1.926 | 7 | 0,13 |
| Sika AG | 39 | 7 | 0,13 |
| | | 19 | 0,36 |
| Summe Schweiz | | 218 | 4,12 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| BT Group PLC | 1.490 | 4 | 0,08 |
| Informa PLC | 525 | 6 | 0,11 |
| Pearson PLC | 513 | 5 | 0,09 |
| Vodafone Group PLC | 5.461 | 9 | 0,17 |
| | | 24 | 0,45 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Compass Group PLC | 313 | 8 | 0,15 |
| Fiat Chrysler Automobiles NV | 304 | 4 | 0,08 |
| Kingfisher PLC | 1.532 | 4 | 0,08 |
| Marks & Spencer Group PLC | 1.265 | 3 | 0,06 |
| Next PLC | 71 | 5 | 0,09 |
| SSP Group PLC | 522 | 5 | 0,09 |
| | | 29 | 0,55 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Associated British Foods PLC | 159 | 5 | 0,10 |
| British American Tobacco PLC | 136 | 5 | 0,10 |
| Diageo PLC | 530 | 23 | 0,44 |
| Imperial Brands PLC | 317 | 7 | 0,13 |
| J Sainsbury PLC | 1.214 | 3 | 0,06 |
| PZ Cussons PLC | 1.904 | 5 | 0,09 |
| Reckitt Benckiser Group PLC | 103 | 8 | 0,15 |
| Tate & Lyle PLC | 568 | $ 5 | 0,09 |
| Tesco PLC | 1.345 | 4 | 0,08 |
| Unilever NV | 126 | 8 | 0,15 |
| Unilever PLC | 101 | 6 | 0,11 |
| WM Morrison Supermarkets PLC | 1.540 | 4 | 0,08 |
| | | 83 | 1,58 |
| **ENERGIE** | | | |
| BP PLC | 1.590 | 11 | 0,21 |
| Ensco Rowan PLC 'A' | 229 | 2 | 0,04 |
| | | 13 | 0,25 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Admiral Group PLC | 187 | 5 | 0,10 |
| Barclays PLC | 2.433 | 5 | 0,10 |
| Direct Line Insurance Group PLC | 1.186 | 5 | 0,10 |
| Legal & General Group PLC | 1.386 | 5 | 0,09 |
| London Stock Exchange Group PLC | 93 | 6 | 0,11 |
| Standard Chartered PLC | 655 | 6 | 0,11 |
| | | 32 | 0,61 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| AstraZeneca PLC | 191 | 16 | 0,30 |
| GlaxoSmithKline PLC | 1.456 | 29 | 0,55 |
| Smith & Nephew PLC | 276 | 6 | 0,11 |
| | | 51 | 0,96 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| Ashtead Group PLC | 202 | 6 | 0,11 |
| BAE Systems PLC | 716 | 5 | 0,10 |
| Bunzl PLC | 168 | 4 | 0,08 |
| easyJet PLC | 308 | 4 | 0,08 |
| Experian PLC | 210 | 6 | 0,11 |
| Morgan Advanced Materials PLC | 1.407 | 5 | 0,10 |
| RELX PLC | 302 | 7 | 0,13 |
| Rentokil Initial PLC | 1.225 | 6 | 0,11 |
| Royal Mail PLC | 1.105 | 3 | 0,06 |
| Spirax-Sarco Engineering PLC | 59 | 7 | 0,13 |
| | | 53 | 1,01 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Anglo American PLC | 235 | 7 | 0,13 |
| BHP Group PLC | 592 | 15 | 0,28 |
| Croda International PLC | 77 | 5 | 0,10 |
| Johnson Matthey PLC | 131 | 6 | 0,11 |
| Linde PLC | 30 | 6 | 0,11 |
| Rio Tinto Ltd. | 91 | 7 | 0,13 |
| Rio Tinto PLC | 104 | 6 | 0,11 |
| Synthomer PLC | 874 | 4 | 0,08 |
| | | 56 | 1,05 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| Centrica PLC | 2.527 | 3 | 0,06 |
| National Grid PLC | 1.447 | 15 | 0,28 |
| Pennon Group PLC | 509 | 5 | 0,09 |
| SSE PLC | 389 | 6 | 0,11 |
| United Utilities Group PLC | 502 | 5 | 0,09 |
| | | 34 | 0,63 |
| Summe Großbritannien | | 375 | 7,09 |
| **USA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| AT&T, Inc. | 865 | 29 | 0,55 |
| Cable One, Inc. | 5 | 6 | 0,11 |
| CBS Corp. NVDR 'B' | 88 | 4 | 0,08 |
| CenturyLink, Inc. | 465 | 5 | 0,10 |
| Comcast Corp. 'A' | 218 | 9 | 0,17 |
| Discovery, Inc. 'A' (a) | 157 | 5 | 0,10 |
| Fox Corp. 'A' | 143 | 5 | 0,10 |
| Interpublic Group of Cos., Inc. | 207 | $ 5 | 0,09 |
| Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' (a) | 122 | 5 | 0,09 |
| Netflix, Inc. (a) | 21 | 8 | 0,15 |
| Omnicom Group, Inc. | 66 | 5 | 0,09 |
| Sprint Corp. (a) | 750 | 5 | 0,09 |
| Tribune Media Co. 'A' | 128 | 6 | 0,11 |
| Verizon Communications, Inc. | 889 | 51 | 0,97 |
| Viacom, Inc. 'B' | 285 | 9 | 0,17 |
| Walt Disney Co. | 315 | 44 | 0,83 |
| | | 201 | 3,80 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Adtalem Global Education, Inc. (a) | 88 | 4 | 0,08 |
| Amazon.com, Inc. (a) | 16 | 30 | 0,57 |
| American Eagle Outfitters, Inc. | 237 | 4 | 0,08 |
| AutoZone, Inc. (a) | 6 | 7 | 0,13 |
| Bed Bath & Beyond, Inc. | 366 | 4 | 0,08 |
| Best Buy Co., Inc. | 108 | 8 | 0,15 |
| Bright Horizons Family Solutions, Inc. (a) | 42 | 6 | 0,11 |
| Brinker International, Inc. | 96 | 4 | 0,08 |
| Carter's, Inc. | 57 | 6 | 0,11 |
| Cheesecake Factory, Inc. | 98 | 4 | 0,08 |
| Chipotle Mexican Grill, Inc. (a) | 10 | 7 | 0,13 |
| Cooper Tire & Rubber Co. | 145 | 5 | 0,10 |
| Cracker Barrel Old Country Store, Inc. | 29 | 5 | 0,10 |
| Darden Restaurants, Inc. | 45 | 6 | 0,11 |
| Deckers Outdoor Corp. (a) | 39 | 7 | 0,13 |
| Designer Brands, Inc. | 194 | 4 | 0,08 |
| Dollar General Corp. | 120 | 16 | 0,30 |
| Domino's Pizza, Inc. | 19 | 5 | 0,10 |
| Foot Locker, Inc. | 98 | 4 | 0,08 |
| Ford Motor Co. | 1.140 | 12 | 0,23 |
| Gap, Inc. | 186 | 3 | 0,06 |
| General Motors Co. | 392 | 15 | 0,28 |
| Gentex Corp. | 221 | 6 | 0,11 |
| Home Depot, Inc. | 84 | 18 | 0,34 |
| Kohl's Corp. | 127 | 6 | 0,11 |
| Kontoor Brands, Inc. (a) | 8 | 0 | 0,00 |
| L Brands, Inc. | 142 | 4 | 0,08 |
| Las Vegas Sands Corp. | 95 | 6 | 0,11 |
| Lear Corp. | 38 | 5 | 0,09 |
| Lowe's Cos., Inc. | 166 | 17 | 0,32 |
| Macy's, Inc. | 281 | 6 | 0,11 |
| Mattel, Inc. (a) | 377 | 4 | 0,08 |
| McDonald's Corp. | 188 | 39 | 0,74 |
| Murphy USA, Inc. (a) | 63 | 5 | 0,09 |
| NIKE, Inc. 'B' | 194 | 16 | 0,30 |
| Nordstrom, Inc. | 83 | 3 | 0,06 |
| O'Reilly Automotive, Inc. (a) | 20 | 7 | 0,13 |
| Qurate Retail, Inc. (a) | 214 | 3 | 0,06 |
| Ralph Lauren Corp. | 41 | 5 | 0,09 |
| Ross Stores, Inc. | 51 | 5 | 0,09 |
| Sally Beauty Holdings, Inc. (a) | 247 | 3 | 0,06 |
| SeaWorld Entertainment, Inc. (a) | 204 | 6 | 0,11 |
| Starbucks Corp. | 183 | 15 | 0,28 |
| Target Corp. | 451 | 39 | 0,74 |
| Tenneco, Inc. 'A' | 147 | 2 | 0,04 |
| Tesla, Inc. (a) | 18 | 4 | 0,08 |
| TJX Cos., Inc. | 345 | 18 | 0,34 |
| Tractor Supply Co. | 53 | 6 | 0,11 |
| Ulta Salon Cosmetics & Fragrance, Inc. (a) | 15 | 5 | 0,09 |
| Urban Outfitters, Inc. (a) | 131 | 3 | 0,06 |
| VF Corp. | 59 | 5 | 0,09 |
| Wendy's Co. | 286 | 6 | 0,11 |
| Williams-Sonoma, Inc. | 81 | 5 | 0,09 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Wyndham Destinations, Inc. | 120 | $ 5 | 0,09 |
| Yum! Brands, Inc. | 56 | 6 | 0,11 |
| | | 449 | 8,48 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Altria Group, Inc. | 185 | 9 | 0,17 |
| Archer-Daniels-Midland Co. | 273 | 11 | 0,21 |
| Brown-Forman Corp. 'B' | 106 | 6 | 0,11 |
| Bunge Ltd. | 109 | 6 | 0,11 |
| Casey's General Stores, Inc. | 38 | 6 | 0,11 |
| Church & Dwight Co., Inc. | 76 | 5 | 0,10 |
| Clorox Co. | 31 | 5 | 0,10 |
| Coca-Cola Co. | 905 | 46 | 0,87 |
| Colgate-Palmolive Co. | 98 | 7 | 0,13 |
| Costco Wholesale Corp. | 101 | 27 | 0,51 |
| Estee Lauder Cos., Inc. 'A' | 34 | 6 | 0,11 |
| Flowers Foods, Inc. | 255 | 6 | 0,11 |
| General Mills, Inc. | 110 | 6 | 0,11 |
| Hershey Co. | 49 | 7 | 0,13 |
| Kellogg Co. | 80 | 4 | 0,08 |
| Kimberly-Clark Corp. | 86 | 11 | 0,21 |
| Kroger Co. | 505 | 11 | 0,21 |
| Lamb Weston Holdings, Inc. | 60 | 4 | 0,08 |
| Lancaster Colony Corp. | 28 | 4 | 0,08 |
| McCormick & Co., Inc. | 34 | 5 | 0,09 |
| Nu Skin Enterprises, Inc. 'A' | 75 | 4 | 0,08 |
| PepsiCo, Inc. | 325 | 43 | 0,81 |
| Philip Morris International, Inc. | 301 | 24 | 0,45 |
| Procter & Gamble Co. | 453 | 50 | 0,95 |
| Sanderson Farms, Inc. | 48 | 6 | 0,11 |
| Sysco Corp. | 107 | 8 | 0,15 |
| Tyson Foods, Inc. 'A' | 73 | 6 | 0,11 |
| Vector Group Ltd. | 354 | 3 | 0,06 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 662 | 73 | 1,38 |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | 80 | 4 | 0,08 |
| | | 413 | 7,81 |
| **ENERGIE** | | | |
| Chevron Corp. | 210 | 26 | 0,49 |
| ConocoPhillips | 418 | 26 | 0,49 |
| Dril-Quip, Inc. (a) | 110 | 5 | 0,10 |
| Exxon Mobil Corp. | 472 | 36 | 0,68 |
| Helmerich & Payne, Inc. | 86 | 4 | 0,08 |
| Hess Corp. | 175 | 11 | 0,21 |
| HollyFrontier Corp. | 234 | 11 | 0,21 |
| Kinder Morgan, Inc. | 250 | 5 | 0,10 |
| Marathon Oil Corp. | 199 | 3 | 0,06 |
| Marathon Petroleum Corp. | 152 | 8 | 0,15 |
| Murphy Oil Corp. | 161 | 4 | 0,08 |
| National Oilwell Varco, Inc. | 217 | 5 | 0,09 |
| Oceaneering International, Inc. (a) | 296 | 6 | 0,11 |
| ONEOK, Inc. | 82 | 6 | 0,11 |
| Phillips 66 | 156 | 15 | 0,28 |
| Valero Energy Corp. | 178 | 15 | 0,28 |
| Whiting Petroleum Corp. (a) | 158 | 3 | 0,06 |
| | | 189 | 3,58 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Aflac, Inc. | 114 | 6 | 0,12 |
| Allstate Corp. | 56 | 6 | 0,12 |
| Ally Financial, Inc. | 197 | 6 | 0,12 |
| American Express Co. | 46 | 6 | 0,11 |
| American International Group, Inc. | 416 | 22 | 0,42 |
| Capitol Federal Financial, Inc. | 398 | 6 | 0,11 |
| CME Group, Inc. | 43 | 8 | 0,15 |
| CNO Financial Group, Inc. | 268 | 4 | 0,08 |
| Discover Financial Services | 72 | 6 | 0,11 |
| Erie Indemnity Co. 'A' | 28 | 7 | 0,13 |
| Hanover Insurance Group, Inc. | 47 | $ 6 | 0,11 |
| Legg Mason, Inc. | 179 | 7 | 0,13 |
| Loews Corp. | 106 | 6 | 0,11 |
| LPL Financial Holdings, Inc. | 82 | 7 | 0,13 |
| Marsh & McLennan Cos., Inc. | 57 | 6 | 0,11 |
| Morningstar, Inc. | 42 | 6 | 0,11 |
| MSCI, Inc. | 33 | 8 | 0,15 |
| Navient Corp. | 395 | 5 | 0,10 |
| Northwest Bancshares, Inc. | 294 | 5 | 0,10 |
| Progressive Corp. | 77 | 6 | 0,11 |
| T Rowe Price Group, Inc. | 53 | 6 | 0,11 |
| Travelers Cos., Inc. | 113 | 17 | 0,32 |
| Voya Financial, Inc. | 111 | 6 | 0,11 |
| | | 168 | 3,17 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Abbott Laboratories | 109 | 9 | 0,17 |
| AbbVie, Inc. | 71 | 5 | 0,10 |
| Amgen, Inc. | 29 | 5 | 0,10 |
| Anthem, Inc. | 75 | 21 | 0,40 |
| Baxter International, Inc. | 78 | 6 | 0,11 |
| Becton Dickinson and Co. | 23 | 6 | 0,11 |
| Biogen, Inc. (a) | 22 | 5 | 0,10 |
| Boston Scientific Corp. (a) | 138 | 6 | 0,11 |
| Cardinal Health, Inc. | 103 | 5 | 0,10 |
| Celgene Corp. (a) | 56 | 5 | 0,10 |
| Chemed Corp. | 16 | 6 | 0,11 |
| Cooper Cos., Inc. | 17 | 6 | 0,11 |
| CVS Health Corp. | 576 | 31 | 0,59 |
| Danaher Corp. | 50 | 7 | 0,13 |
| Eli Lilly & Co. | 60 | 7 | 0,13 |
| Gilead Sciences, Inc. | 163 | 11 | 0,21 |
| HCA Healthcare, Inc. | 48 | 7 | 0,13 |
| Humana, Inc. | 18 | 5 | 0,10 |
| Illumina, Inc. (a) | 16 | 6 | 0,11 |
| Intuitive Surgical, Inc. (a) | 10 | 5 | 0,09 |
| Johnson & Johnson | 289 | 40 | 0,76 |
| Merck & Co., Inc. | 395 | 33 | 0,62 |
| Myriad Genetics, Inc. (a) | 145 | 4 | 0,08 |
| Pfizer, Inc. | 247 | 11 | 0,21 |
| ResMed, Inc. | 49 | 6 | 0,11 |
| Stryker Corp. | 30 | 6 | 0,11 |
| Tenet Healthcare Corp. (a) | 210 | 4 | 0,08 |
| Thermo Fisher Scientific, Inc. | 22 | 7 | 0,13 |
| | | 275 | 5,21 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| 3M Co. | 78 | 14 | 0,27 |
| AGCO Corp. | 88 | 7 | 0,13 |
| Allison Transmission Holdings, Inc. | 111 | 5 | 0,10 |
| American Airlines Group, Inc. | 131 | 4 | 0,08 |
| AO Smith Corp. | 110 | 5 | 0,10 |
| Applied Industrial Technologies, Inc. | 77 | 5 | 0,10 |
| CH Robinson Worldwide, Inc. | 55 | 5 | 0,10 |
| Cintas Corp. | 28 | 7 | 0,13 |
| Copart, Inc. (a) | 100 | 7 | 0,13 |
| CSX Corp. | 71 | 6 | 0,11 |
| Cummins, Inc. | 35 | 6 | 0,11 |
| Deere & Co. | 67 | 11 | 0,21 |
| Deluxe Corp. | 100 | 4 | 0,08 |
| Emerson Electric Co. | 109 | 7 | 0,13 |
| Expeditors International of Washington, Inc. | 69 | 5 | 0,10 |
| Fastenal Co. | 178 | 6 | 0,11 |
| Fluor Corp. | 112 | 4 | 0,08 |
| GATX Corp. | 63 | 5 | 0,10 |
| General Dynamics Corp. | 28 | 5 | 0,10 |
| General Electric Co. | 601 | $ 6 | 0,11 |
| Hillenbrand, Inc. | 107 | 4 | 0,08 |
| Honeywell International, Inc. | 32 | 6 | 0,11 |
| IAA, Inc. (a) | 88 | 3 | 0,06 |
| IDEX Corp. | 37 | 6 | 0,11 |
| Illinois Tool Works, Inc. | 38 | 6 | 0,11 |
| Jacobs Engineering Group, Inc. | 68 | 6 | 0,11 |
| KAR Auction Services, Inc. | 88 | 2 | 0,04 |
| KBR, Inc. | 260 | 7 | 0,13 |
| Landstar System, Inc. | 48 | 5 | 0,10 |
| Lennox International, Inc. | 23 | 6 | 0,11 |
| ManpowerGroup, Inc. | 64 | 6 | 0,11 |
| Masco Corp. | 161 | 6 | 0,11 |
| MSC Industrial Direct Co., Inc. 'A' | 57 | 4 | 0,08 |
| Norfolk Southern Corp. | 30 | 6 | 0,11 |
| Northrop Grumman Corp. | 29 | 9 | 0,17 |
| Parker-Hannifin Corp. | 30 | 5 | 0,10 |
| Quanta Services, Inc. | 148 | 6 | 0,11 |
| Raytheon Co. | 28 | 5 | 0,10 |
| Robert Half International, Inc. | 80 | 5 | 0,10 |
| TransDigm Group, Inc. (a) | 11 | 5 | 0,09 |
| Union Pacific Corp. | 34 | 6 | 0,11 |
| United Parcel Service, Inc. 'B' | 63 | 7 | 0,13 |
| Verisk Analytics, Inc. | 41 | 6 | 0,11 |
| Wabtec Corp. | 3 | 0 | 0,00 |
| Waste Management, Inc. | 55 | 6 | 0,11 |
| WESCO International, Inc. (a) | 96 | 5 | 0,09 |
| WW Grainger, Inc. | 19 | 5 | 0,09 |
| Xylem, Inc. | 73 | 6 | 0,11 |
| | | 273 | 5,17 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Adobe, Inc. (a) | 31 | 9 | 0,17 |
| ANSYS, Inc. (a) | 32 | 7 | 0,13 |
| Apple, Inc. | 129 | 26 | 0,49 |
| Autodesk, Inc. (a) | 39 | 6 | 0,11 |
| Automatic Data Processing, Inc. | 35 | 6 | 0,11 |
| Avnet, Inc. | 119 | 5 | 0,10 |
| Booz Allen Hamilton Holding Corp. | 97 | 6 | 0,11 |
| Broadcom, Inc. | 17 | 5 | 0,10 |
| Broadridge Financial Solutions, Inc. | 47 | 6 | 0,11 |
| CACI International, Inc. 'A' (a) | 28 | 6 | 0,11 |
| Cadence Design Systems, Inc. (a) | 81 | 6 | 0,11 |
| CDW Corp. | 58 | 6 | 0,11 |
| Cisco Systems, Inc. | 183 | 10 | 0,19 |
| Corning, Inc. | 286 | 9 | 0,17 |
| Cree, Inc. (a) | 116 | 6 | 0,11 |
| F5 Networks, Inc. (a) | 28 | 4 | 0,08 |
| Fiserv, Inc. (a) | 65 | 6 | 0,11 |
| Global Payments, Inc. | 48 | 8 | 0,15 |
| Hewlett Packard Enterprise Co. | 330 | 5 | 0,10 |
| HP, Inc. | 332 | 7 | 0,13 |
| International Business Machines Corp. | 452 | 62 | 1,17 |
| Intuit, Inc. | 32 | 8 | 0,15 |
| Jack Henry & Associates, Inc. | 37 | 5 | 0,10 |
| Juniper Networks, Inc. | 177 | 5 | 0,10 |
| Mastercard, Inc. 'A' | 73 | 19 | 0,36 |
| Microsoft Corp. | 236 | 32 | 0,61 |
| Motorola Solutions, Inc. | 84 | 14 | 0,27 |
| Oracle Corp. | 98 | 6 | 0,11 |
| Paychex, Inc. | 75 | 6 | 0,11 |
| PayPal Holdings, Inc. (a) | 71 | 8 | 0,15 |
| QUALCOMM, Inc. | 170 | 13 | 0,25 |
| Red Hat, Inc. (a) | 29 | 5 | 0,10 |
| salesforce.com, Inc. (a) | 32 | 5 | 0,10 |
| Seagate Technology PLC | 253 | 12 | 0,23 |
| Texas Instruments, Inc. | 83 | 10 | 0,19 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Total System Services, Inc. | 57 | $ 7 | 0,13 |
| VeriSign, Inc. (a) | 39 | 8 | 0,15 |
| Visa, Inc. 'A' | 119 | 21 | 0,40 |
| Worldpay, Inc. 'A' (a) | 60 | 7 | 0,13 |
| Xerox Corp. | 186 | 7 | 0,13 |
| Xilinx, Inc. | 39 | 5 | 0,09 |
| | | 414 | 7,83 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| AptarGroup, Inc. | 49 | 6 | 0,11 |
| CF Industries Holdings, Inc. | 111 | 5 | 0,10 |
| Commercial Metals Co. | 261 | 5 | 0,10 |
| Ecolab, Inc. | 32 | 6 | 0,11 |
| Innophos Holdings, Inc. | 164 | 5 | 0,10 |
| Kaiser Aluminum Corp. | 54 | 5 | 0,10 |
| LyondellBasell Industries NV 'A' | 202 | 17 | 0,32 |
| Mosaic Co. | 210 | 5 | 0,10 |
| PPG Industries, Inc. | 47 | 6 | 0,11 |
| Reliance Steel & Aluminum Co. | 62 | 6 | 0,11 |
| Silgan Holdings, Inc. | 203 | 6 | 0,11 |
| Sonoco Products Co. | 89 | 6 | 0,11 |
| | | 78 | 1,48 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| AES Corp. | 404 | 7 | 0,13 |
| Duke Energy Corp. | 57 | 5 | 0,10 |
| Entergy Corp. | 58 | 6 | 0,11 |
| Exelon Corp. | 255 | 12 | 0,23 |
| FirstEnergy Corp. | 129 | 5 | 0,10 |
| Hawaiian Electric Industries, Inc. | 134 | 6 | 0,11 |
| NextEra Energy, Inc. | 29 | 6 | 0,11 |
| Southern Co. | 96 | 5 | 0,10 |
| Vistra Energy Corp. | 209 | 5 | 0,10 |
| | | 57 | 1,09 |
| Summe USA | | 2.517 | 47,62 |
| Summe Stammaktien | | 4.971 | 94,04 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Henkel AG & Co. KGaA | 45 | $ 4 | 0,08 |
| Volkswagen AG | 64 | 11 | 0,21 |
| | | 15 | 0,29 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | |
| American Tower Corp. | 38 | 8 | 0,15 |
| Brixmor Property Group, Inc. | 318 | 6 | 0,11 |
| Charter Hall Group | 777 | 6 | 0,11 |
| Columbia Property Trust, Inc. | 227 | 5 | 0,10 |
| Crown Castle International Corp. | 45 | 6 | 0,11 |
| Equity Commonwealth | 165 | 5 | 0,10 |
| Equity LifeStyle Properties, Inc. | 50 | 6 | 0,11 |
| Equity Residential | 72 | 5 | 0,10 |
| Extra Space Storage, Inc. | 54 | 6 | 0,11 |
| Growthpoint Properties Australia Ltd. | 1.786 | 5 | 0,10 |
| HCP, Inc. | 159 | 5 | 0,10 |
| Healthcare Realty Trust, Inc. | 176 | 6 | 0,11 |
| Invesco Mortgage Capital, Inc. | 333 | 5 | 0,10 |
| Japan Real Estate Investment Corp. | 1 | 6 | 0,11 |
| Japan Retail Fund Investment Corp. | 4 | 8 | 0,15 |
| Killam Apartment Real Estate Investment Trust | 348 | 5 | 0,10 |
| Kite Realty Group Trust | 313 | 5 | 0,10 |
| Klepierre S.A. | 144 | 5 | 0,10 |
| Lamar Advertising Co. 'A' | 68 | 6 | 0,11 |
| Land Securities Group PLC | 416 | 4 | 0,08 |
| Life Storage, Inc. | 52 | 5 | 0,10 |
| Link REIT | 500 | 6 | 0,11 |
| Macerich Co. | 98 | 3 | 0,06 |
| Mack-Cali Realty Corp. | 243 | 6 | 0,11 |
| Medical Properties Trust, Inc. | 305 | 5 | 0,10 |
| Mid-America Apartment Communities, Inc. | 53 | 6 | 0,11 |
| National Retail Properties, Inc. | 103 | 5 | 0,10 |
| Nippon Accommodations Fund, Inc. | 1 | 6 | 0,11 |
| Omega Healthcare Investors, Inc. | 145 | 5 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| PennyMac Mortgage Investment Trust | 241 | $ 5 | 0,10 |
| Piedmont Office Realty Trust, Inc. 'A' | 269 | 5 | 0,10 |
| Premier Investment Corp. | 6 | 8 | 0,15 |
| Prologis, Inc. | 70 | 6 | 0,11 |
| PS Business Parks, Inc. | 37 | 6 | 0,11 |
| Public Storage | 24 | 6 | 0,11 |
| Rayonier, Inc. | 159 | 5 | 0,09 |
| Realty Income Corp. | 68 | 5 | 0,09 |
| Redwood Trust, Inc. | 302 | 5 | 0,09 |
| Ryman Hospitality Properties, Inc. | 66 | 5 | 0,09 |
| Senior Housing Properties Trust | 328 | 3 | 0,06 |
| Simon Property Group, Inc. | 47 | 8 | 0,15 |
| Sun Communities, Inc. | 42 | 5 | 0,09 |
| Two Harbors Investment Corp. | 347 | 4 | 0,08 |
| UDR, Inc. | 111 | 5 | 0,09 |
| Ventas, Inc. | 78 | 5 | 0,09 |
| Washington Real Estate Investment Trust | 176 | 5 | 0,09 |
| Weingarten Realty Investors | 177 | 5 | 0,09 |
| Welltower, Inc. | 70 | 6 | 0,11 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | 262 | 4,95 |
| **RECHTE** | | | |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. - Exp. 07.11.2019 | 128 | 0 | 0,00 |
| Repsol S.A. - Exp. 07.09.2019 | 513 | 0 | 0,01 |
| | | 0 | 0,01 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 5.248** | **99,29** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 5.248** | **99,29** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 38** | **0,71** |
| **Nettovermögen** | | **$ 5.286** | **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.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 3.051 | $ 2.197 | $ 0 | $ 5.248 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 2.523 | $ 2.058 | $ 0 | $ 4.581 |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 ( %) | 31. Dez. 2018 ( %) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 99,29 | 99,08 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Stammaktien | | |
| Australien | 2,33 | 2,38 |
| Österreich | 0,09 | 0,09 |
| Belgien | 0,48 | 0,50 |
| Kanada | 3,78 | 3,11 |
| Dänemark | 0,57 | 0,59 |
| Finnland | 0,59 | 0,61 |
| Frankreich | 3,60 | 3,85 |
| Deutschland | 2,95 | 3,03 |
| Hongkong | 0,69 | 0,87 |
| Irland | 0,85 | 0,95 |
| Israel | 0,33 | 0,38 |
| Italien | 0,92 | 0,83 |
| Japan | 11,06 | 11,77 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,12 | 0,00 |
| Luxemburg | 0,15 | 0,20 |
| Macau | 0,11 | 0,11 |
| Niederlande | 1,93 | 2,11 |
| Neuseeland | 0,09 | 0,11 |
| Norwegen | 0,59 | 0,76 |
| Portugal | 0,12 | 0,12 |
| Singapur | 0,54 | 0,66 |
| Spanien | 1,72 | 1,74 |
| Schweden | 1,60 | 1,76 |
| Schweiz | 4,12 | 4,07 |
| Großbritannien | 7,09 | 7,38 |
| Vereinigte Staaten | 47,62 | 46,09 |
| Vorzugswertpapiere | 0,29 | 0,33 |
| Real Estate Investment Trusts | 4,95 | 4,68 |
| Bezugsrechte | 0,01 | 0,00 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,71 | 0,92 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **BERMUDAS** | | | |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Arch Capital Group Ltd. (a) | 63 | $ 2 | 0,07 |
| **IRLAND** | | | |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Accenture PLC 'A' | 41 | 8 | 0,24 |
| **LUXEMBURG** | | | |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Ternium S.A. SP - ADR | 65 | 1 | 0,05 |
| **SCHWEIZ** | | | |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Chubb Ltd. | 58 | 9 | 0,27 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Coca-Cola European Partners PLC | 40 | 2 | 0,07 |
| **ENERGIE** | | | |
| Ensco Rowan PLC 'A' | 104 | 1 | 0,03 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Aon PLC | 19 | 4 | 0,13 |
| Willis Towers Watson PLC | 12 | 2 | 0,06 |
| | | 6 | 0,19 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Linde PLC | 27 | 6 | 0,17 |
| Summe Großbritannien | | 15 | 0,46 |
| **USA** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| AMC Networks, Inc. 'A' (a) | 5 | 0 | 0,00 |
| AT&T, Inc. | 966 | 32 | 1,01 |
| Cable One, Inc. | 2 | 2 | 0,06 |
| Cars.com, Inc. (a) | 16 | 0 | 0,00 |
| CBS Corp. NVDR 'B' | 96 | 5 | 0,16 |
| CenturyLink, Inc. | 508 | 6 | 0,19 |
| Charter Communications, Inc. 'A' (a) | 8 | 3 | 0,10 |
| Comcast Corp. 'A' | 240 | 10 | 0,32 |
| Discovery, Inc. 'A' (a) | 82 | 3 | 0,10 |
| Fox Corp. 'A' | 157 | 6 | 0,19 |
| Gannett Co., Inc. | 128 | 1 | 0,03 |
| InterActiveCorp (a) | 8 | 2 | 0,06 |
| Interpublic Group of Cos., Inc. | 117 | 3 | 0,09 |
| Liberty Broadband Corp. 'C' (a) | 4 | 1 | 0,03 |
| Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM 'C' (a) | 111 | 4 | 0,13 |
| Netflix, Inc. (a) | 31 | 11 | 0,35 |
| New Media Investment Group, Inc. | 22 | 0 | 0,00 |
| New York Times Co. 'A' | 15 | 1 | 0,03 |
| News Corp. 'A' | 154 | 2 | 0,06 |
| Omnicom Group, Inc. | 59 | 5 | 0,16 |
| Scholastic Corp. | 7 | 0 | 0,00 |
| Sinclair Broadcast Group, Inc. 'A' | 10 | 1 | 0,03 |
| Sirius XM Holdings, Inc. | 215 | 1 | 0,03 |
| Sprint Corp. (a) | 45 | 0 | 0,00 |
| T-Mobile US, Inc. (a) | 14 | 1 | 0,03 |
| TEGNA, Inc. | 36 | 1 | 0,03 |
| Telephone & Data Systems, Inc. | 40 | 1 | 0,03 |
| Tribune Media Co. 'A' | 101 | 5 | 0,16 |
| TripAdvisor, Inc. (a) | 7 | 0 | 0,00 |
| U.S. Cellular Corp. (a) | 7 | 0 | 0,00 |
| Verizon Communications, Inc. | 1.074 | $ 61 | 1,93 |
| Viacom, Inc. 'B' | 320 | 10 | 0,32 |
| Walt Disney Co. | 387 | 54 | 1,71 |
| | | 232 | 7,34 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Aaron's, Inc. | 19 | 1 | 0,03 |
| Abercrombie & Fitch Co. 'A' | 90 | 1 | 0,03 |
| Adient PLC | 20 | 1 | 0,03 |
| Adtalem Global Education, Inc. (a) | 35 | 2 | 0,07 |
| Advance Auto Parts, Inc. | 18 | 3 | 0,10 |
| Amazon.com, Inc. (a) | 19 | 36 | 1,14 |
| American Eagle Outfitters, Inc. | 255 | 4 | 0,13 |
| Aramark | 13 | 1 | 0,03 |
| Asbury Automotive Group, Inc. (a) | 21 | 2 | 0,06 |
| AutoNation, Inc. (a) | 8 | 0 | 0,00 |
| AutoZone, Inc. (a) | 7 | 8 | 0,25 |
| Bed Bath & Beyond, Inc. | 229 | 3 | 0,10 |
| Best Buy Co., Inc. | 77 | 5 | 0,16 |
| Big Lots, Inc. | 28 | 1 | 0,03 |
| Bloomin' Brands, Inc. | 39 | 1 | 0,03 |
| Booking Holdings, Inc. (a) | 1 | 2 | 0,06 |
| Bright Horizons Family Solutions, Inc. (a) | 12 | 2 | 0,06 |
| Brinker International, Inc. | 103 | 4 | 0,13 |
| Buckle, Inc. | 43 | 1 | 0,03 |
| Caleres, Inc. | 27 | 1 | 0,03 |
| Carter's, Inc. | 26 | 3 | 0,10 |
| Cheesecake Factory, Inc. | 55 | 2 | 0,06 |
| Chico's FAS, Inc. | 192 | 1 | 0,03 |
| Children's Place, Inc. | 4 | 0 | 0,00 |
| Chipotle Mexican Grill, Inc. (a) | 8 | 6 | 0,19 |
| Churchill Downs, Inc. | 12 | 1 | 0,03 |
| Columbia Sportswear Co. | 3 | 0 | 0,00 |
| Cooper Tire & Rubber Co. | 68 | 2 | 0,06 |
| Cooper-Standard Holding, Inc. (a) | 5 | 0 | 0,00 |
| Core-Mark Holding Co., Inc. | 30 | 1 | 0,03 |
| Cracker Barrel Old Country Store, Inc. | 13 | 2 | 0,06 |
| Dana, Inc. | 57 | 1 | 0,03 |
| Darden Restaurants, Inc. | 29 | 4 | 0,13 |
| Deckers Outdoor Corp. (a) | 17 | 3 | 0,10 |
| Designer Brands, Inc. | 104 | 2 | 0,06 |
| Dick's Sporting Goods, Inc. | 38 | 1 | 0,03 |
| Dillard's, Inc. 'A' | 13 | 1 | 0,03 |
| Dollar General Corp. | 114 | 15 | 0,48 |
| Domino's Pizza, Inc. | 15 | 4 | 0,13 |
| Dorman Products, Inc. (a) | 14 | 1 | 0,03 |
| Dunkin' Brands Group, Inc. | 24 | 2 | 0,06 |
| eBay, Inc. | 69 | 3 | 0,10 |
| Extended Stay America, Inc. | 17 | 0 | 0,00 |
| Foot Locker, Inc. | 81 | 3 | 0,10 |
| Ford Motor Co. | 1.193 | 12 | 0,38 |
| Fossil Group, Inc. (a) | 89 | 1 | 0,03 |
| G-III Apparel Group Ltd. (a) | 28 | 1 | 0,03 |
| GameStop Corp. 'A' | 109 | 1 | 0,03 |
| Gap, Inc. | 180 | 3 | 0,10 |
| General Motors Co. | 407 | 16 | 0,51 |
| Genesco, Inc. (a) | 19 | 1 | 0,03 |
| Gentex Corp. | 83 | 2 | 0,06 |
| Genuine Parts Co. | 18 | 2 | 0,06 |
| Goodyear Tire & Rubber Co. | 13 | 0 | 0,00 |
| Graham Holdings Co. 'B' | 2 | 1 | 0,03 |
| Group 1 Automotive, Inc. | 16 | 1 | 0,03 |
| Guess?, Inc. | 64 | 1 | 0,03 |
| H&R Block, Inc. | 88 | 3 | 0,10 |
| Hanesbrands, Inc. | 64 | 1 | 0,03 |
| Harley-Davidson, Inc. | 24 | 1 | 0,03 |
| Hasbro, Inc. | 5 | $ 1 | 0,03 |
| Home Depot, Inc. | 108 | 23 | 0,73 |
| Houghton Mifflin Harcourt Co. (a) | 39 | 0 | 0,00 |
| Jack in the Box, Inc. | 17 | 1 | 0,03 |
| Kohl's Corp. | 136 | 7 | 0,22 |
| Kontoor Brands, Inc. (a) | 9 | 0 | 0,00 |
| L Brands, Inc. | 53 | 1 | 0,03 |
| La-Z-Boy, Inc. | 29 | 1 | 0,03 |
| Las Vegas Sands Corp. | 52 | 3 | 0,10 |
| Lear Corp. | 8 | 1 | 0,03 |
| Leggett & Platt, Inc. | 39 | 2 | 0,06 |
| Lowe's Cos., Inc. | 170 | 17 | 0,54 |
| Macy's, Inc. | 301 | 7 | 0,22 |
| Marriott International, Inc. 'A' | 10 | 1 | 0,03 |
| Marriott Vacations Worldwide Corp. | 4 | 0 | 0,00 |
| Mattel, Inc. (a) | 185 | 2 | 0,06 |
| McDonald's Corp. | 218 | 45 | 1,42 |
| MDC Holdings, Inc. | 14 | 1 | 0,03 |
| Meritage Homes Corp. (a) | 7 | 0 | 0,00 |
| Murphy USA, Inc. (a) | 29 | 2 | 0,06 |
| NIKE, Inc. 'B' | 218 | 18 | 0,57 |
| Nordstrom, Inc. | 89 | 3 | 0,10 |
| NVR, Inc. (a) | 1 | 3 | 0,10 |
| O'Reilly Automotive, Inc. (a) | 25 | 9 | 0,29 |
| Office Depot, Inc. | 337 | 1 | 0,03 |
| Penske Automotive Group, Inc. | 7 | 0 | 0,00 |
| Pool Corp. | 10 | 2 | 0,06 |
| Qurate Retail, Inc. (a) | 74 | 1 | 0,03 |
| Ralph Lauren Corp. | 29 | 3 | 0,10 |
| Regis Corp. (a) | 17 | 0 | 0,00 |
| RH (a) | 3 | 0 | 0,00 |
| Ross Stores, Inc. | 60 | 6 | 0,19 |
| Sally Beauty Holdings, Inc. (a) | 143 | 2 | 0,06 |
| SeaWorld Entertainment, Inc. (a) | 91 | 3 | 0,10 |
| Service Corp. International | 33 | 2 | 0,06 |
| ServiceMaster Global Holdings, Inc. (a) | 34 | 2 | 0,06 |
| Signet Jewelers Ltd. | 25 | 1 | 0,03 |
| Six Flags Entertainment Corp. | 33 | 2 | 0,06 |
| Sleep Number Corp. (a) | 11 | 1 | 0,03 |
| Sotheby's (a) | 7 | 0 | 0,00 |
| Starbucks Corp. | 183 | 15 | 0,48 |
| Steven Madden Ltd. | 28 | 1 | 0,03 |
| Sturm Ruger & Co., Inc. | 14 | 1 | 0,03 |
| Target Corp. | 439 | 38 | 1,20 |
| Tempur Sealy International, Inc. (a) | 6 | 0 | 0,00 |
| Tenneco, Inc. 'A' | 10 | 0 | 0,00 |
| Tesla, Inc. (a) | 13 | 3 | 0,10 |
| Texas Roadhouse, Inc. | 19 | 1 | 0,03 |
| Thor Industries, Inc. | 7 | 0 | 0,00 |
| TJX Cos., Inc. | 325 | 17 | 0,54 |
| Tractor Supply Co. | 32 | 4 | 0,13 |
| Tupperware Brands Corp. | 12 | 0 | 0,00 |
| Ulta Salon Cosmetics & Fragrance, Inc. (a) | 9 | 3 | 0,10 |
| Under Armour, Inc. (a) | 41 | 1 | 0,03 |
| Urban Outfitters, Inc. (a) | 41 | 1 | 0,03 |
| Vail Resorts, Inc. | 8 | 2 | 0,06 |
| VF Corp. | 66 | 6 | 0,19 |
| Visteon Corp. (a) | 12 | 1 | 0,03 |
| Wendy's Co. | 259 | 5 | 0,16 |
| Williams-Sonoma, Inc. | 47 | 3 | 0,10 |
| Wyndham Destinations, Inc. | 22 | 1 | 0,03 |
| Wynn Resorts Ltd. | 3 | 0 | 0,00 |
| Yum! Brands, Inc. | 74 | 8 | 0,25 |
| | | 469 | 14,83 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Altria Group, Inc. | 188 | $ 9 | 0,28 |
| Archer-Daniels-Midland Co. | 306 | 13 | 0,41 |
| B&G Foods, Inc. | 12 | 0 | 0,00 |
| Boston Beer Co., Inc. 'A' (a) | 5 | 2 | 0,06 |
| Brown-Forman Corp. 'B' | 62 | 3 | 0,10 |
| Bunge Ltd. | 126 | 7 | 0,22 |
| Cal-Maine Foods, Inc. | 29 | 1 | 0,03 |
| Campbell Soup Co. | 38 | 2 | 0,06 |
| Casey's General Stores, Inc. | 34 | 5 | 0,16 |
| Church & Dwight Co., Inc. | 60 | 4 | 0,13 |
| Clorox Co. | 23 | 4 | 0,13 |
| Coca-Cola Co. | 1.014 | 52 | 1,64 |
| Colgate-Palmolive Co. | 129 | 9 | 0,28 |
| Conagra Brands, Inc. | 38 | 1 | 0,03 |
| Constellation Brands, Inc. 'A' | 6 | 1 | 0,03 |
| Costco Wholesale Corp. | 127 | 34 | 1,08 |
| Darling Ingredients, Inc. (a) | 19 | 0 | 0,00 |
| Edgewell Personal Care Co. (a) | 20 | 1 | 0,03 |
| Estee Lauder Cos., Inc. 'A' | 41 | 8 | 0,25 |
| Flowers Foods, Inc. | 80 | 2 | 0,06 |
| Fresh Del Monte Produce, Inc. | 9 | 0 | 0,00 |
| General Mills, Inc. | 182 | 10 | 0,32 |
| Herbalife Nutrition Ltd. (a) | 37 | 2 | 0,06 |
| Hershey Co. | 37 | 5 | 0,16 |
| Hormel Foods Corp. | 53 | 2 | 0,06 |
| Ingredion, Inc. | 4 | 0 | 0,00 |
| J&J Snack Foods Corp. | 2 | 0 | 0,00 |
| JM Smucker Co. | 33 | 4 | 0,13 |
| Kellogg Co. | 62 | 3 | 0,10 |
| Keurig Dr Pepper, Inc. | 54 | 2 | 0,06 |
| Kimberly-Clark Corp. | 90 | 12 | 0,38 |
| Kroger Co. | 562 | 12 | 0,38 |
| Lamb Weston Holdings, Inc. | 35 | 2 | 0,06 |
| Lancaster Colony Corp. | 21 | 3 | 0,10 |
| McCormick & Co., Inc. | 28 | 4 | 0,13 |
| Mondelez International, Inc. 'A' | 102 | 6 | 0,19 |
| Monster Beverage Corp. (a) | 23 | 2 | 0,06 |
| Nu Skin Enterprises, Inc. 'A' | 34 | 2 | 0,06 |
| PepsiCo, Inc. | 369 | 48 | 1,52 |
| Performance Food Group Co. (a) | 39 | 2 | 0,06 |
| Philip Morris International, Inc. | 345 | 27 | 0,85 |
| Post Holdings, Inc. (a) | 4 | 0 | 0,00 |
| Procter & Gamble Co. | 527 | 58 | 1,83 |
| Sanderson Farms, Inc. | 21 | 3 | 0,10 |
| Sprouts Farmers Market, Inc. (a) | 56 | 1 | 0,03 |
| Sysco Corp. | 157 | 11 | 0,35 |
| TreeHouse Foods, Inc. (a) | 26 | 1 | 0,03 |
| Tyson Foods, Inc. 'A' | 41 | 3 | 0,10 |
| U.S. Foods Holding Corp. (a) | 48 | 2 | 0,06 |
| United Natural Foods, Inc. (a) | 34 | 0 | 0,00 |
| Universal Corp. | 13 | 1 | 0,03 |
| USANA Health Sciences, Inc. (a) | 3 | 0 | 0,00 |
| Vector Group Ltd. | 35 | 0 | 0,00 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 705 | 78 | 2,47 |
| Walgreens Boots Alliance, Inc. | 93 | 5 | 0,16 |
| Weis Markets, Inc. | 6 | 0 | 0,00 |
| | | 469 | 14,82 |
| **ENERGIE** | | | |
| Apache Corp. | 49 | 2 | 0,07 |
| Archrock, Inc. | 45 | 1 | 0,03 |
| Chevron Corp. | 259 | 32 | 1,01 |
| CNX Resources Corp. (a) | 31 | 0 | 0,00 |
| ConocoPhillips | 472 | 29 | 0,92 |
| CVR Energy, Inc. | 8 | 0 | 0,00 |
| Diamond Offshore Drilling, Inc. (a) | 38 | 0 | 0,00 |
| Dril-Quip, Inc. (a) | 28 | 1 | 0,03 |
| Exxon Mobil Corp. | 568 | $ 44 | 1,39 |
| Green Plains, Inc. | 55 | 1 | 0,03 |
| Helix Energy Solutions Group, Inc. (a) | 63 | 1 | 0,03 |
| Hess Corp. | 188 | 12 | 0,38 |
| HollyFrontier Corp. | 175 | 8 | 0,25 |
| Kinder Morgan, Inc. | 90 | 2 | 0,07 |
| Marathon Oil Corp. | 360 | 5 | 0,16 |
| Marathon Petroleum Corp. | 186 | 10 | 0,32 |
| McDermott International, Inc. (a) | 40 | 0 | 0,00 |
| Murphy Oil Corp. | 91 | 2 | 0,07 |
| Nabors Industries Ltd. | 177 | 1 | 0,03 |
| National Oilwell Varco, Inc. | 192 | 4 | 0,13 |
| Oasis Petroleum, Inc. (a) | 67 | 0 | 0,00 |
| Oceaneering International, Inc. (a) | 69 | 1 | 0,03 |
| Oil States International, Inc. (a) | 25 | 1 | 0,03 |
| ONEOK, Inc. | 55 | 4 | 0,13 |
| Patterson-UTI Energy, Inc. | 34 | 0 | 0,00 |
| PBF Energy, Inc. 'A' | 45 | 1 | 0,03 |
| Peabody Energy Corp. | 25 | 1 | 0,03 |
| Phillips 66 | 183 | 17 | 0,54 |
| QEP Resources, Inc. (a) | 152 | 1 | 0,03 |
| SM Energy Co. | 81 | 1 | 0,03 |
| Superior Energy Services, Inc. (a) | 107 | 0 | 0,00 |
| Targa Resources Corp. | 19 | 1 | 0,03 |
| Transocean Ltd. | 152 | 1 | 0,03 |
| Unit Corp. (a) | 21 | 0 | 0,00 |
| Valero Energy Corp. | 209 | 18 | 0,57 |
| Whiting Petroleum Corp. (a) | 85 | 2 | 0,06 |
| World Fuel Services Corp. | 38 | 1 | 0,03 |
| | | 205 | 6,49 |
| **FINANZWERTE** | | | |
| Affiliated Managers Group, Inc. | 3 | 0 | 0,00 |
| Aflac, Inc. | 203 | 11 | 0,35 |
| Alleghany Corp. (a) | 2 | 1 | 0,03 |
| Allstate Corp. | 87 | 9 | 0,29 |
| Ally Financial, Inc. | 165 | 5 | 0,16 |
| Ambac Financial Group, Inc. (a) | 23 | 0 | 0,00 |
| American Express Co. | 67 | 8 | 0,25 |
| American Financial Group, Inc. | 4 | 0 | 0,00 |
| American International Group, Inc. | 439 | 23 | 0,73 |
| Arthur J Gallagher & Co. | 28 | 3 | 0,10 |
| Assurant, Inc. | 20 | 2 | 0,07 |
| Brighthouse Financial, Inc. (a) | 9 | 0 | 0,00 |
| Brown & Brown, Inc. | 65 | 2 | 0,06 |
| Capital One Financial Corp. | 34 | 3 | 0,10 |
| Capitol Federal Financial, Inc. | 21 | 0 | 0,00 |
| Cincinnati Financial Corp. | 21 | 2 | 0,06 |
| CIT Group, Inc. | 30 | 2 | 0,06 |
| CME Group, Inc. | 49 | 10 | 0,32 |
| CNO Financial Group, Inc. | 77 | 1 | 0,03 |
| Commerce Bancshares, Inc. | 24 | 1 | 0,03 |
| Credit Acceptance Corp. (a) | 1 | 1 | 0,03 |
| Discover Financial Services | 21 | 2 | 0,06 |
| Erie Indemnity Co. 'A' | 14 | 4 | 0,13 |
| FactSet Research Systems, Inc. | 7 | 2 | 0,06 |
| Federated Investors, Inc. 'B' | 15 | 1 | 0,03 |
| Fidelity National Financial, Inc. | 37 | 2 | 0,06 |
| First American Financial Corp. | 33 | 2 | 0,06 |
| First Republic Bank | 10 | 1 | 0,03 |
| FirstCash, Inc. | 16 | 2 | 0,06 |
| Franklin Resources, Inc. | 61 | 2 | 0,06 |
| Genworth Financial, Inc. 'A' (a) | 326 | 1 | 0,03 |
| Glacier Bancorp, Inc. | 7 | 0 | 0,00 |
| Hanover Insurance Group, Inc. | 14 | 2 | 0,06 |
| Intercontinental Exchange, Inc. | 64 | 6 | 0,19 |
| Kemper Corp. | 22 | 2 | 0,06 |
| Legg Mason, Inc. | 32 | $ 1 | 0,03 |
| Loews Corp. | 96 | 5 | 0,16 |
| LPL Financial Holdings, Inc. | 43 | 4 | 0,13 |
| Markel Corp. (a) | 1 | 1 | 0,03 |
| Marsh & McLennan Cos., Inc. | 112 | 11 | 0,35 |
| MBIA, Inc. (a) | 87 | 1 | 0,03 |
| Mercury General Corp. | 25 | 2 | 0,06 |
| Moody's Corp. | 9 | 2 | 0,06 |
| Morningstar, Inc. | 7 | 1 | 0,03 |
| MSCI, Inc. | 19 | 5 | 0,16 |
| Nasdaq, Inc. | 16 | 2 | 0,06 |
| National General Holdings Corp. | 11 | 0 | 0,00 |
| Navient Corp. | 153 | 2 | 0,06 |
| New York Community Bancorp, Inc. | 30 | 0 | 0,00 |
| Northwest Bancshares, Inc. | 17 | 0 | 0,00 |
| Old Republic International Corp. | 67 | 2 | 0,06 |
| PRA Group, Inc. (a) | 11 | 0 | 0,00 |
| Primerica, Inc. | 3 | 0 | 0,00 |
| ProAssurance Corp. | 34 | 1 | 0,03 |
| Progressive Corp. | 109 | 9 | 0,29 |
| S&P Global, Inc. | 18 | 4 | 0,13 |
| Santander Consumer USA Holdings, Inc. | 45 | 1 | 0,03 |
| SEI Investments Co. | 18 | 1 | 0,03 |
| Selective Insurance Group, Inc. | 4 | 0 | 0,00 |
| Stewart Information Services Corp. | 7 | 0 | 0,00 |
| T Rowe Price Group, Inc. | 33 | 4 | 0,13 |
| Travelers Cos., Inc. | 146 | 22 | 0,70 |
| United Bankshares, Inc. | 9 | 0 | 0,00 |
| Voya Financial, Inc. | 73 | 4 | 0,13 |
| Waddell & Reed Financial, Inc. 'A' | 81 | 1 | 0,03 |
| Webster Financial Corp. | 6 | 0 | 0,00 |
| World Acceptance Corp. (a) | 3 | 1 | 0,03 |
| WR Berkley Corp. | 28 | 2 | 0,06 |
| | | 202 | 6,37 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Abbott Laboratories | 130 | 11 | 0,35 |
| AbbVie, Inc. | 99 | 7 | 0,22 |
| AmerisourceBergen Corp. | 5 | 0 | 0,00 |
| Amgen, Inc. | 46 | 9 | 0,29 |
| Anthem, Inc. | 78 | 22 | 0,70 |
| Baxter International, Inc. | 104 | 9 | 0,29 |
| Becton Dickinson and Co. | 32 | 8 | 0,25 |
| Bio-Rad Laboratories, Inc. 'A' (a) | 5 | 2 | 0,07 |
| Bio-Techne Corp. | 2 | 0 | 0,00 |
| Biogen, Inc. (a) | 20 | 5 | 0,16 |
| BioMarin Pharmaceutical, Inc. (a) | 23 | 2 | 0,06 |
| Boston Scientific Corp. (a) | 103 | 4 | 0,13 |
| Brookdale Senior Living, Inc. (a) | 55 | 0 | 0,00 |
| Bruker Corp. | 9 | 1 | 0,03 |
| Cardinal Health, Inc. | 106 | 5 | 0,16 |
| Catalent, Inc. (a) | 9 | 1 | 0,03 |
| Celgene Corp. (a) | 52 | 5 | 0,16 |
| Centene Corp. (a) | 30 | 2 | 0,06 |
| Charles River Laboratories International, Inc. (a) | 3 | 0 | 0,00 |
| Chemed Corp. | 8 | 3 | 0,10 |
| Cigna Corp. | 20 | 3 | 0,10 |
| Cooper Cos., Inc. | 9 | 3 | 0,10 |
| CVS Health Corp. | 705 | 38 | 1,20 |
| Danaher Corp. | 79 | 11 | 0,35 |
| DaVita, Inc. (a) | 23 | 1 | 0,03 |
| Dentsply Sirona, Inc. | 8 | 1 | 0,03 |
| Eli Lilly & Co. | 71 | 8 | 0,25 |
| Encompass Health Corp. | 22 | 1 | 0,03 |
| Gilead Sciences, Inc. | 186 | 13 | 0,41 |
| HCA Healthcare, Inc. | 62 | 8 | 0,25 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund
(Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Henry Schein, Inc. (a) | 29 | $ 2 | 0,06 |
| Hill-Rom Holdings, Inc. | 3 | 0 | 0,00 |
| Humana, Inc. | 27 | 7 | 0,22 |
| Illumina, Inc. (a) | 19 | 7 | 0,22 |
| Incyte Corp. (a) | 24 | 2 | 0,06 |
| Intuitive Surgical, Inc. (a) | 12 | 6 | 0,19 |
| IQVIA Holdings, Inc. (a) | 15 | 2 | 0,06 |
| Johnson & Johnson | 362 | 50 | 1,58 |
| Laboratory Corp. of America Holdings (a) | 4 | 1 | 0,03 |
| Magellan Health, Inc. (a) | 14 | 1 | 0,03 |
| Masimo Corp. (a) | 12 | 2 | 0,06 |
| McKesson Corp. | 13 | 2 | 0,06 |
| MEDNAX, Inc. (a) | 26 | 1 | 0,03 |
| Merck & Co., Inc. | 446 | 37 | 1,17 |
| Mettler-Toledo International, Inc. (a) | 2 | 2 | 0,06 |
| Molina Healthcare, Inc. (a) | 3 | 0 | 0,00 |
| Myriad Genetics, Inc. (a) | 56 | 2 | 0,06 |
| Patterson Cos., Inc. | 18 | 0 | 0,00 |
| PerkinElmer, Inc. | 15 | 2 | 0,06 |
| Pfizer, Inc. | 389 | 17 | 0,54 |
| Premier, Inc. 'A' (a) | 10 | 0 | 0,00 |
| Quest Diagnostics, Inc. | 27 | 3 | 0,10 |
| Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (a) | 5 | 2 | 0,06 |
| ResMed, Inc. | 49 | 6 | 0,19 |
| Select Medical Holdings Corp. (a) | 24 | 0 | 0,00 |
| Stryker Corp. | 36 | 7 | 0,22 |
| Teleflex, Inc. | 5 | 2 | 0,06 |
| Tenet Healthcare Corp. (a) | 106 | 2 | 0,06 |
| Thermo Fisher Scientific, Inc. | 30 | 9 | 0,29 |
| United Therapeutics Corp. (a) | 12 | 1 | 0,03 |
| Universal Health Services, Inc. 'B' | 7 | 1 | 0,03 |
| Varian Medical Systems, Inc. (a) | 2 | 0 | 0,00 |
| Waters Corp. (a) | 2 | 1 | 0,03 |
| WellCare Health Plans, Inc. (a) | 6 | 2 | 0,06 |
| West Pharmaceutical Services, Inc. | 11 | 1 | 0,03 |
| Zoetis, Inc. | 16 | 2 | 0,06 |
| | | 365 | 11,52 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| 3M Co. | 93 | 16 | 0,51 |
| AAR Corp. | 112 | 4 | 0,13 |
| ABM Industries, Inc. | 42 | 2 | 0,07 |
| Actuant Corp. 'A' | 17 | 0 | 0,00 |
| AECOM (a) | 10 | 0 | 0,00 |
| AGCO Corp. | 23 | 2 | 0,07 |
| Aircastle Ltd. | 16 | 0 | 0,00 |
| Allegiant Travel Co. | 3 | 0 | 0,00 |
| Allison Transmission Holdings, Inc. | 44 | 2 | 0,07 |
| AMERCO | 1 | 0 | 0,00 |
| American Airlines Group, Inc. | 108 | 4 | 0,13 |
| AO Smith Corp. | 27 | 1 | 0,03 |
| Applied Industrial Technologies, Inc. | 14 | 1 | 0,03 |
| ArcBest Corp. | 23 | 1 | 0,03 |
| Armstrong World Industries, Inc. | 20 | 2 | 0,07 |
| Atlas Air Worldwide Holdings, Inc. (a) | 18 | 1 | 0,03 |
| Avis Budget Group, Inc. (a) | 36 | 1 | 0,03 |
| Brady Corp. 'A' | 6 | 0 | 0,00 |
| BWX Technologies, Inc. | 88 | 5 | 0,16 |
| CH Robinson Worldwide, Inc. | 50 | 4 | 0,13 |
| Cintas Corp. | 20 | 5 | 0,16 |
| Clean Harbors, Inc. (a) | 5 | 0 | 0,00 |
| Comfort Systems USA, Inc. | 6 | 0 | 0,00 |
| Copart, Inc. (a) | 80 | 6 | 0,19 |
| CoStar Group, Inc. (a) | 4 | 2 | 0,07 |
| Covanta Holding Corp. | 78 | $ 1 | 0,03 |
| Crane Co. | 24 | 2 | 0,06 |
| CSX Corp. | 61 | 5 | 0,16 |
| Cummins, Inc. | 29 | 5 | 0,16 |
| Curtiss-Wright Corp. | 33 | 4 | 0,13 |
| Deere & Co. | 77 | 13 | 0,41 |
| Delta Air Lines, Inc. | 28 | 2 | 0,06 |
| Deluxe Corp. | 7 | 0 | 0,00 |
| Donaldson Co., Inc. | 27 | 1 | 0,03 |
| Emerson Electric Co. | 73 | 5 | 0,16 |
| Expeditors International of Washington, Inc. | 71 | 5 | 0,16 |
| Fastenal Co. | 106 | 4 | 0,13 |
| Fluor Corp. | 67 | 2 | 0,06 |
| Fortive Corp. | 9 | 1 | 0,03 |
| FTI Consulting, Inc. (a) | 22 | 2 | 0,06 |
| GATX Corp. | 19 | 2 | 0,06 |
| Generac Holdings, Inc. (a) | 26 | 2 | 0,06 |
| General Dynamics Corp. | 49 | 9 | 0,29 |
| General Electric Co. | 561 | 6 | 0,19 |
| Genesee & Wyoming, Inc. 'A' (a) | 4 | 0 | 0,00 |
| Graco, Inc. | 7 | 0 | 0,00 |
| Greenbrier Cos., Inc. | 31 | 1 | 0,03 |
| Harris Corp. | 21 | 4 | 0,13 |
| HD Supply Holdings, Inc. (a) | 39 | 2 | 0,06 |
| Healthcare Services Group, Inc. | 28 | 1 | 0,03 |
| HEICO Corp. | 24 | 3 | 0,10 |
| Herman Miller, Inc. | 12 | 1 | 0,03 |
| Hertz Global Holdings, Inc. (a) | 84 | 1 | 0,03 |
| Hexcel Corp. | 63 | 5 | 0,16 |
| Hillenbrand, Inc. | 7 | 0 | 0,00 |
| HNI Corp. | 8 | 0 | 0,00 |
| Honeywell International, Inc. | 44 | 8 | 0,25 |
| Hub Group, Inc. 'A' (a) | 28 | 1 | 0,03 |
| Hubbell, Inc. | 3 | 0 | 0,00 |
| IAA, Inc. (a) | 38 | 2 | 0,06 |
| IDEX Corp. | 10 | 2 | 0,06 |
| Illinois Tool Works, Inc. | 40 | 6 | 0,19 |
| Ingersoll-Rand PLC | 13 | 2 | 0,06 |
| ITT, Inc. | 26 | 2 | 0,06 |
| Jacobs Engineering Group, Inc. | 65 | 6 | 0,19 |
| JB Hunt Transport Services, Inc. | 13 | 1 | 0,03 |
| Johnson Controls International PLC | 55 | 2 | 0,06 |
| KAR Auction Services, Inc. | 38 | 1 | 0,03 |
| KBR, Inc. | 110 | 3 | 0,10 |
| Knight-Swift Transportation Holdings, Inc. | 11 | 0 | 0,00 |
| Landstar System, Inc. | 14 | 2 | 0,06 |
| Lennox International, Inc. | 12 | 3 | 0,10 |
| Lincoln Electric Holdings, Inc. | 18 | 2 | 0,06 |
| Macquarie Infrastructure Corp. | 77 | 3 | 0,10 |
| ManpowerGroup, Inc. | 20 | 2 | 0,06 |
| Masco Corp. | 43 | 2 | 0,06 |
| Masonite International Corp. (a) | 6 | 0 | 0,00 |
| Moog, Inc. 'A' | 26 | 3 | 0,10 |
| MRC Global, Inc. (a) | 60 | 1 | 0,03 |
| MSA Safety, Inc. | 3 | 0 | 0,00 |
| MSC Industrial Direct Co., Inc. 'A' | 28 | 2 | 0,06 |
| Mueller Industries, Inc. | 12 | 0 | 0,00 |
| Neilsen Holdings PLC | 14 | 0 | 0,00 |
| Nordson Corp. | 7 | 1 | 0,03 |
| Norfolk Southern Corp. | 21 | 4 | 0,13 |
| Northrop Grumman Corp. | 53 | 17 | 0,54 |
| NOW, Inc. (a) | 105 | 2 | 0,06 |
| Old Dominion Freight Line, Inc. | 6 | 1 | 0,03 |
| Parker-Hannifin Corp. | 20 | 3 | 0,10 |
| Pitney Bowes, Inc. | 177 | 1 | 0,03 |
| Quad/Graphics, Inc. | 28 | 0 | 0,00 |
| Quanta Services, Inc. | 43 | $ 2 | 0,06 |
| Raytheon Co. | 54 | 9 | 0,29 |
| Republic Services, Inc. | 34 | 3 | 0,10 |
| Robert Half International, Inc. | 34 | 2 | 0,06 |
| Rockwell Automation, Inc. | 12 | 2 | 0,06 |
| Rollins, Inc. | 36 | 1 | 0,03 |
| Roper Technologies, Inc. | 8 | 3 | 0,10 |
| Rush Enterprises, Inc. 'A' | 8 | 0 | 0,00 |
| SkyWest, Inc. | 23 | 1 | 0,03 |
| Snap-on, Inc. | 5 | 1 | 0,03 |
| Southwest Airlines Co. | 14 | 1 | 0,03 |
| Spirit AeroSystems Holdings, Inc. 'A' | 34 | 3 | 0,10 |
| Spirit Airlines, Inc. (a) | 6 | 0 | 0,00 |
| SPX FLOW, Inc. (a) | 9 | 0 | 0,00 |
| Steelcase, Inc. 'A' | 81 | 1 | 0,03 |
| Stericycle, Inc. (a) | 19 | 1 | 0,03 |
| Teledyne Technologies, Inc. (a) | 21 | 6 | 0,19 |
| Terex Corp. | 37 | 1 | 0,03 |
| Timken Co. | 36 | 2 | 0,06 |
| Toro Co. | 24 | 2 | 0,06 |
| TransDigm Group, Inc. (a) | 14 | 7 | 0,22 |
| TransUnion | 24 | 2 | 0,06 |
| Trinity Industries, Inc. | 38 | 1 | 0,03 |
| Triumph Group, Inc. | 58 | 1 | 0,03 |
| TrueBlue, Inc. (a) | 12 | 0 | 0,00 |
| Tutor Perini Corp. (a) | 18 | 0 | 0,00 |
| Union Pacific Corp. | 65 | 11 | 0,35 |
| United Continental Holdings, Inc. (a) | 3 | 0 | 0,00 |
| United Parcel Service, Inc. 'B' | 108 | 11 | 0,35 |
| United Rentals, Inc. (a) | 12 | 2 | 0,06 |
| Universal Forest Products, Inc. | 27 | 1 | 0,03 |
| Verisk Analytics, Inc. | 34 | 5 | 0,16 |
| Wabash National Corp. | 27 | 1 | 0,03 |
| WABCO Holdings, Inc. (a) | 8 | 1 | 0,03 |
| Wabtec Corp. | 14 | 1 | 0,03 |
| Waste Connections, Inc. | 21 | 2 | 0,06 |
| Waste Management, Inc. | 66 | 8 | 0,25 |
| Watsco, Inc. | 20 | 3 | 0,10 |
| Werner Enterprises, Inc. | 9 | 0 | 0,00 |
| WESCO International, Inc. (a) | 30 | 2 | 0,06 |
| Woodward, Inc. | 29 | 3 | 0,10 |
| WW Grainger, Inc. | 23 | 6 | 0,19 |
| Xylem, Inc. | 35 | 3 | 0,10 |
| | | 345 | 10,92 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| ACI Worldwide, Inc. (a) | 10 | 0 | 0,00 |
| Adobe, Inc. (a) | 28 | 8 | 0,25 |
| Alliance Data Systems Corp. | 4 | 1 | 0,03 |
| Amdocs Ltd. | 5 | 0 | 0,00 |
| Anixter International, Inc. (a) | 7 | 1 | 0,03 |
| ANSYS, Inc. (a) | 16 | 3 | 0,10 |
| Apple, Inc. | 158 | 31 | 0,98 |
| Applied Materials, Inc. | 26 | 1 | 0,03 |
| Arrow Electronics, Inc. (a) | 22 | 2 | 0,07 |
| Autodesk, Inc. (a) | 21 | 4 | 0,13 |
| Automatic Data Processing, Inc. | 31 | 5 | 0,16 |
| Avnet, Inc. | 63 | 3 | 0,10 |
| Benchmark Electronics, Inc. | 13 | 0 | 0,00 |
| Booz Allen Hamilton Holding Corp. | 82 | 6 | 0,19 |
| Broadcom, Inc. | 21 | 6 | 0,19 |
| Broadridge Financial Solutions, Inc. | 28 | 4 | 0,13 |
| CACI International, Inc. 'A' (a) | 11 | 2 | 0,06 |
| Cadence Design Systems, Inc. (a) | 30 | 2 | 0,06 |
| CDK Global, Inc. | 6 | 0 | 0,00 |
| CDW Corp. | 35 | 4 | 0,13 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Ciena Corp. (a) | 11 | $ 1 | 0,03 |
| Cinemark Holdings, Inc. | 39 | 2 | 0,06 |
| Cirrus Logic, Inc. (a) | 37 | 2 | 0,06 |
| Cisco Systems, Inc. | 295 | 16 | 0,51 |
| Citrix Systems, Inc. | 12 | 1 | 0,03 |
| Conduent, Inc. (a) | 111 | 1 | 0,03 |
| Corning, Inc. | 371 | 12 | 0,38 |
| Cree, Inc. (a) | 53 | 3 | 0,10 |
| Dolby Laboratories, Inc. 'A' | 20 | 1 | 0,03 |
| Electronic Arts, Inc. (a) | 3 | 0 | 0,00 |
| EPAM Systems, Inc. (a) | 2 | 0 | 0,00 |
| Euronet Worldwide, Inc. (a) | 3 | 1 | 0,03 |
| F5 Networks, Inc. (a) | 17 | 3 | 0,10 |
| Fair Isaac Corp. (a) | 7 | 2 | 0,06 |
| Fidelity National Information Services, Inc. | 24 | 3 | 0,10 |
| First Data Corp. 'A' (a) | 46 | 1 | 0,03 |
| Fiserv, Inc. (a) | 65 | 6 | 0,19 |
| FLIR Systems, Inc. | 90 | 5 | 0,16 |
| Gartner, Inc. (a) | 12 | 2 | 0,06 |
| Genpact Ltd. | 51 | 2 | 0,06 |
| Global Payments, Inc. | 15 | 2 | 0,06 |
| Hewlett Packard Enterprise Co. | 224 | 3 | 0,10 |
| HP, Inc. | 397 | 8 | 0,25 |
| Insight Enterprises, Inc. (a) | 18 | 1 | 0,03 |
| International Business Machines Corp. | 434 | 60 | 1,90 |
| Intuit, Inc. | 36 | 10 | 0,32 |
| Jabil, Inc. | 40 | 1 | 0,03 |
| Jack Henry & Associates, Inc. | 27 | 4 | 0,13 |
| Juniper Networks, Inc. | 78 | 2 | 0,06 |
| Keysight Technologies, Inc. (a) | 21 | 2 | 0,06 |
| KLA-Tencor Corp. | 15 | 2 | 0,06 |
| Live Nation Entertainment, Inc. (a) | 8 | 1 | 0,03 |
| Madison Square Garden Co. 'A' (a) | 5 | 1 | 0,03 |
| Manhattan Associates, Inc. (a) | 6 | 1 | 0,03 |
| ManTech International Corp. 'A' | 14 | 1 | 0,03 |
| Mastercard, Inc. 'A' | 94 | 25 | 0,79 |
| Microsoft Corp. | 285 | 38 | 1,20 |
| Motorola Solutions, Inc. | 80 | 13 | 0,41 |
| NETGEAR, Inc. (a) | 7 | 0 | 0,00 |
| Oracle Corp. | 109 | 6 | 0,19 |
| Paychex, Inc. | 59 | 5 | 0,16 |
| PayPal Holdings, Inc. (a) | 66 | 8 | 0,25 |
| Plantronics, Inc. | 11 | 0 | 0,00 |
| Plexus Corp. (a) | 5 | 0 | 0,00 |
| PTC, Inc. (a) | 12 | 1 | 0,03 |
| Qorvo, Inc. (a) | 4 | 0 | 0,00 |
| QUALCOMM, Inc. | 190 | 15 | 0,48 |
| Red Hat, Inc. (a) | 18 | 3 | 0,10 |
| Sabre Corp. | 17 | 0 | 0,00 |
| salesforce.com, Inc. (a) | 54 | 8 | 0,25 |
| Sanmina Corp. (a) | 16 | 1 | 0,03 |
| ScanSource, Inc. (a) | 8 | 0 | 0,00 |
| Science Applications International Corp. | 12 | 1 | 0,03 |
| Seagate Technology PLC | 216 | 10 | 0,32 |
| Skyworks Solutions, Inc. | 4 | 0 | 0,00 |
| SS&C Technologies Holdings, Inc. | 27 | 2 | 0,06 |
| Sykes Enterprises, Inc. (a) | 11 | 0 | 0,00 |
| Symantec Corp. | 72 | 2 | 0,06 |
| Synaptics, Inc. (a) | 7 | 0 | 0,00 |
| SYNNEX Corp. | 4 | 0 | 0,00 |
| Synopsys, Inc. (a) | 15 | 2 | 0,06 |
| Tech Data Corp. (a) | 18 | 2 | 0,06 |
| Teradata Corp. (a) | 22 | 1 | 0,03 |
| Texas Instruments, Inc. | 82 | 10 | 0,32 |
| Total System Services, Inc. | 32 | 4 | 0,13 |
| Ubiquiti Networks, Inc. | 3 | $ 0 | 0,00 |
| VeriSign, Inc. (a) | 20 | 4 | 0,13 |
| Visa, Inc. 'A' | 146 | 25 | 0,79 |
| Vishay Intertechnology, Inc. | 46 | 1 | 0,03 |
| VMware, Inc. 'A' | 8 | 1 | 0,03 |
| Western Union Co. | 107 | 2 | 0,06 |
| Worldpay, Inc. 'A' (a) | 33 | 4 | 0,13 |
| Xerox Corp. | 105 | 4 | 0,13 |
| Xilinx, Inc. | 36 | 4 | 0,13 |
| Zebra Technologies Corp. 'A' (a) | 5 | 1 | 0,03 |
| | | 449 | 14,20 |
| **BAUSTOFFE** | | | |
| Air Products & Chemicals, Inc. | 17 | 4 | 0,13 |
| Alcoa Corp. (a) | 76 | 2 | 0,07 |
| Allegheny Technologies, Inc. (a) | 59 | 2 | 0,07 |
| AptarGroup, Inc. | 24 | 3 | 0,10 |
| Ashland Global Holdings, Inc. | 4 | 0 | 0,00 |
| Avery Dennison Corp. | 16 | 2 | 0,07 |
| Axalta Coating Systems Ltd. (a) | 12 | 0 | 0,00 |
| Ball Corp. | 47 | 3 | 0,10 |
| Boise Cascade Co. | 12 | 0 | 0,00 |
| Carpenter Technology Corp. | 21 | 1 | 0,03 |
| Celanese Corp. | 13 | 1 | 0,03 |
| CF Industries Holdings, Inc. | 88 | 4 | 0,13 |
| Cleveland-Cliffs, Inc. | 212 | 2 | 0,07 |
| Commercial Metals Co. | 75 | 1 | 0,03 |
| Compass Minerals International, Inc. | 18 | 1 | 0,03 |
| Crown Holdings, Inc. (a) | 29 | 2 | 0,06 |
| Domtar Corp. | 34 | 2 | 0,06 |
| Ecolab, Inc. | 33 | 7 | 0,22 |
| Freeport-McMoRan, Inc. | 123 | 2 | 0,06 |
| Graphic Packaging Holding Co. | 88 | 1 | 0,03 |
| Innophos Holdings, Inc. | 12 | 0 | 0,00 |
| Innospec, Inc. | 4 | 0 | 0,00 |
| International Flavors & Fragrances, Inc. | 12 | 2 | 0,06 |
| Kaiser Aluminum Corp. | 9 | 1 | 0,03 |
| LyondellBasell Industries NV 'A' | 187 | 16 | 0,51 |
| Materion Corp. | 6 | 0 | 0,00 |
| Mosaic Co. | 228 | 6 | 0,19 |
| NewMarket Corp. | 3 | 1 | 0,03 |
| Owens-Illinois, Inc. | 19 | 0 | 0,00 |
| PolyOne Corp. | 27 | 1 | 0,03 |
| PPG Industries, Inc. | 26 | 3 | 0,10 |
| Reliance Steel & Aluminum Co. | 19 | 2 | 0,06 |
| RPM International, Inc. | 31 | 2 | 0,06 |
| Schnitzer Steel Industries, Inc. 'A' | 16 | 1 | 0,03 |
| Schweitzer-Mauduit International, Inc. | 10 | 0 | 0,00 |
| Scotts Miracle-Gro Co. | 12 | 1 | 0,03 |
| Sealed Air Corp. | 37 | 2 | 0,06 |
| Sensient Technologies Corp. | 13 | 1 | 0,03 |
| Silgan Holdings, Inc. | 34 | 1 | 0,03 |
| Sonoco Products Co. | 37 | 3 | 0,10 |
| Trinseo S.A. | 6 | 0 | 0,00 |
| Worthington Industries, Inc. | 8 | 0 | 0,00 |
| WR Grace & Co. | 30 | 2 | 0,06 |
| | | 85 | 2,70 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| AES Corp. | 444 | 8 | 0,25 |
| ALLETE, Inc. | 3 | 0 | 0,00 |
| Alliant Energy Corp. | 6 | 0 | 0,00 |
| Ameren Corp. | 8 | 1 | 0,03 |
| American Electric Power Co., Inc. | 33 | 3 | 0,10 |
| Atmos Energy Corp. | 13 | 1 | 0,03 |
| Black Hills Corp. | 4 | $ 0 | 0,00 |
| CMS Energy Corp. | 16 | 1 | 0,03 |
| Dominion Energy, Inc. | 27 | 2 | 0,06 |
| DTE Energy Co. | 12 | 2 | 0,06 |
| Duke Energy Corp. | 56 | 5 | 0,16 |
| Entergy Corp. | 46 | 5 | 0,16 |
| Eversource Energy | 21 | 2 | 0,06 |
| Exelon Corp. | 305 | 15 | 0,48 |
| FirstEnergy Corp. | 75 | 3 | 0,10 |
| Hawaiian Electric Industries, Inc. | 7 | 0 | 0,00 |
| IDACORP, Inc. | 3 | 0 | 0,00 |
| New Jersey Resources Corp. | 7 | 0 | 0,00 |
| NextEra Energy, Inc. | 34 | 7 | 0,22 |
| NRG Energy, Inc. | 32 | 1 | 0,03 |
| OGE Energy Corp. | 10 | 0 | 0,00 |
| ONE Gas, Inc. | 4 | 0 | 0,00 |
| Pinnacle West Capital Corp. | 3 | 0 | 0,00 |
| PNM Resources, Inc. | 6 | 0 | 0,00 |
| Portland General Electric Co. | 6 | 0 | 0,00 |
| PPL Corp. | 96 | 3 | 0,10 |
| Public Service Enterprise Group, Inc. | 38 | 2 | 0,06 |
| Sempra Energy | 20 | 3 | 0,10 |
| Southern Co. | 120 | 7 | 0,22 |
| Southwest Gas Holdings, Inc. | 4 | 0 | 0,00 |
| Spire, Inc. | 8 | 1 | 0,03 |
| UGI Corp. | 5 | 0 | 0,00 |
| Vistra Energy Corp. | 114 | 3 | 0,10 |
| WEC Energy Group, Inc. | 21 | 2 | 0,06 |
| Xcel Energy, Inc. | 41 | 3 | 0,10 |
| | | 80 | 2,54 |
| Summe USA | | 2.901 | 91,73 |
| Summe Stammaktien | | 2.936 | 92,82 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | |
| Acadia Realty Trust | 15 | 0 | 0,00 |
| AGNC Investment Corp. | 24 | 0 | 0,00 |
| Alexandria Real Estate Equities, Inc. | 13 | 2 | 0,07 |
| American Campus Communities, Inc. | 37 | 2 | 0,07 |
| American Homes 4 Rent 'A' | 13 | 0 | 0,00 |
| American Tower Corp. | 47 | 10 | 0,32 |
| Annaly Capital Management, Inc. | 150 | 1 | 0,03 |
| Apartment Investment & Management Co. | 33 | 2 | 0,07 |
| Apollo Commercial Real Estate Finance, Inc. | 16 | 0 | 0,00 |
| Apple Hospitality REIT, Inc. | 94 | 2 | 0,07 |
| AvalonBay Communities, Inc. | 15 | 3 | 0,10 |
| Blackstone Mortgage Trust, Inc. 'A' | 42 | 2 | 0,07 |
| Boston Properties, Inc. | 12 | 2 | 0,07 |
| Brandywine Realty Trust | 104 | 2 | 0,07 |
| Brixmor Property Group, Inc. | 126 | 2 | 0,07 |
| Camden Property Trust | 18 | 2 | 0,07 |
| Chimera Investment Corp. | 79 | 2 | 0,06 |
| Colony Capital, Inc. | 375 | 2 | 0,06 |
| Columbia Property Trust, Inc. | 68 | 1 | 0,03 |
| CoreCivic, Inc. | 64 | 1 | 0,03 |
| Corporate Office Properties Trust | 12 | 0 | 0,00 |
| Crown Castle International Corp. | 47 | 6 | 0,19 |
| CubeSmart | 50 | 2 | 0,06 |
| CyrusOne, Inc. | 19 | 1 | 0,03 |
| Digital Realty Trust, Inc. | 29 | 3 | 0,10 |
| Douglas Emmett, Inc. | 42 | 2 | 0,06 |
| Duke Realty Corp. | 89 | 3 | 0,10 |
| EPR Properties | 21 | 2 | 0,06 |
| Equinix, Inc. | 1 | 1 | 0,03 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| Equity Commonwealth | 48 | $ 2 | 0,06 |
| Equity LifeStyle Properties, Inc. | 15 | 2 | 0,06 |
| Equity Residential | 93 | 7 | 0,22 |
| Essex Property Trust, Inc. | 8 | 2 | 0,06 |
| Extra Space Storage, Inc. | 25 | 3 | 0,10 |
| Federal Realty Investment Trust | 17 | 2 | 0,06 |
| First Industrial Realty Trust, Inc. | 9 | 0 | 0,00 |
| Gaming and Leisure Properties, Inc. | 44 | 2 | 0,06 |
| HCP, Inc. | 151 | 5 | 0,16 |
| Healthcare Realty Trust, Inc. | 73 | 2 | 0,06 |
| Healthcare Trust of America, Inc. 'A' | 84 | 2 | 0,06 |
| Highwoods Properties, Inc. | 33 | 1 | 0,03 |
| Hospitality Properties Trust | 55 | 1 | 0,03 |
| Host Hotels & Resorts, Inc. | 77 | 1 | 0,03 |
| Hudson Pacific Properties, Inc. | 10 | 0 | 0,00 |
| Invesco Mortgage Capital, Inc. | 84 | 1 | 0,03 |
| Iron Mountain, Inc. | 44 | 1 | 0,03 |
| Kilroy Realty Corp. | 21 | 2 | 0,06 |
| Kimco Realty Corp. | 163 | 3 | 0,10 |
| Kite Realty Group Trust | 75 | 1 | 0,03 |
| Ladder Capital Corp. | 48 | 1 | 0,03 |
| Lamar Advertising Co. 'A' | 35 | 3 | 0,10 |
| Lexington Realty Trust | 289 | 3 | 0,10 |
| Liberty Property Trust | 34 | 2 | 0,06 |
| Life Storage, Inc. | 16 | 2 | 0,06 |
| Macerich Co. | 52 | 2 | 0,06 |
| Mack-Cali Realty Corp. | 58 | 1 | 0,03 |
| Medical Properties Trust, Inc. | 105 | 2 | 0,06 |
| MFA Financial, Inc. | 182 | 1 | 0,03 |
| Mid-America Apartment Communities, Inc. | 20 | 2 | 0,06 |
| National Health Investors, Inc. | 3 | $ 0 | 0,00 |
| National Retail Properties, Inc. | 42 | 2 | 0,06 |
| New Residential Investment Corp. | 114 | 2 | 0,06 |
| Omega Healthcare Investors, Inc. | 67 | 3 | 0,10 |
| Outfront Media, Inc. | 73 | 2 | 0,06 |
| Paramount Group, Inc. | 103 | 1 | 0,03 |
| Park Hotels & Resorts, Inc. | 78 | 2 | 0,06 |
| PennyMac Mortgage Investment Trust | 58 | 1 | 0,03 |
| Physicians Realty Trust | 122 | 2 | 0,06 |
| Piedmont Office Realty Trust, Inc. 'A' | 79 | 2 | 0,06 |
| Prologis, Inc. | 65 | 5 | 0,16 |
| PS Business Parks, Inc. | 11 | 2 | 0,06 |
| Public Storage | 24 | 6 | 0,19 |
| Rayonier, Inc. | 47 | 1 | 0,03 |
| Realty Income Corp. | 36 | 3 | 0,10 |
| Redwood Trust, Inc. | 78 | 1 | 0,03 |
| Regency Centers Corp. | 32 | 2 | 0,06 |
| Retail Opportunity Investments Corp. | 17 | 0 | 0,00 |
| Retail Properties of America, Inc. 'A' | 123 | 1 | 0,03 |
| Ryman Hospitality Properties, Inc. | 19 | 2 | 0,06 |
| Sabra Health Care REIT, Inc. | 23 | 0 | 0,00 |
| SBA Communications Corp. (a) | 2 | 0 | 0,00 |
| Senior Housing Properties Trust | 317 | 3 | 0,10 |
| Simon Property Group, Inc. | 62 | 10 | 0,33 |
| SITE Centers Corp. | 116 | 2 | 0,06 |
| SL Green Realty Corp. | 3 | 0 | 0,00 |
| Spirit Realty Capital, Inc. | 43 | 2 | 0,06 |
| Starwood Property Trust, Inc. | 79 | 2 | 0,06 |
| STORE Capital Corp. | 111 | 4 | 0,13 |
| Sun Communities, Inc. | 33 | $ 4 | 0,13 |
| Tanger Factory Outlet Centers, Inc. | 56 | 1 | 0,03 |
| Taubman Centers, Inc. | 24 | 1 | 0,03 |
| Two Harbors Investment Corp. | 152 | 2 | 0,06 |
| UDR, Inc. | 55 | 3 | 0,10 |
| Ventas, Inc. | 93 | 6 | 0,19 |
| VEREIT, Inc. | 196 | 2 | 0,06 |
| Vornado Realty Trust | 6 | 0 | 0,00 |
| Washington Prime Group, Inc. | 210 | 1 | 0,03 |
| Washington Real Estate Investment Trust | 11 | 0 | 0,00 |
| Weingarten Realty Investors | 53 | 2 | 0,06 |
| Welltower, Inc. | 77 | 6 | 0,19 |
| Weyerhaeuser Co. | 12 | 0 | 0,00 |
| WP Carey, Inc. | 52 | 4 | 0,13 |
| Xenia Hotels & Resorts, Inc. | 64 | 1 | 0,03 |
| Summe Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | | $ 213 | 6,74 |
| **RECHTE** | | | |
| Hertz Global Holdings, Inc. - Exp. 12.07.2019 | 84 | 0 | 0,00 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 3.149** | **99,56** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 3.149** | **99,56** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 14** | **0,44** |
| **Nettovermögen** | | **$ 3.163** | **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.**

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 3.149 | $ 0 | $0 | $ 3.149 |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 2.713 | $ 0 | $ 0 | $ 2.713 |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 99,56 | 99,49 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Stammaktien | | |
| Bermuda | 0,07 | 0,00 |
| Irland | 0,24 | 0,46 |
| Luxemburg | 0,05 | 0,00 |
| Schweiz | 0,27 | 0,20 |
| Großbritannien | 0,46 | 0,00 |
| Vereinigte Staaten | 91,73 | 92,86 |
| Real Estate Investment Trusts | 6,74 | 5,97 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,44 | 0,51 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **ALBANIEN** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Albania Government International Bond** | | | |
| 3,500 % fällig am 09.10.2025 | € 700 | $ 847 | 0,12 |
| **ARGENTINIEN** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | 2.700 | 2.408 | 0,35 |
| 3,380 % fällig am 31.12.2038 | 5.300 | 3.450 | 0,51 |
| 3,750 % fällig am 31.12.2038 | $ 10.600 | 6.228 | 0,91 |
| 4,625 % fällig am 11.01.2023 | 3.400 | 2.729 | 0,40 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | € 700 | 583 | 0,09 |
| 5,625 % fällig am 26.01.2022 | $ 1.300 | 1.098 | 0,16 |
| 5,875 % fällig am 11.01.2028 | 3.400 | 2.595 | 0,38 |
| 6,875 % fällig am 22.04.2021 | 2.200 | 1.937 | 0,28 |
| 6,875 % fällig am 26.01.2027 | 1.750 | 1.408 | 0,21 |
| 6,875 % fällig am 11.01.2048 | 4.650 | 3.458 | 0,51 |
| 7,125 % fällig am 06.07.2036 | 3.100 | 2.406 | 0,35 |
| 7,125 % fällig am 28.06.2117 | 200 | 150 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 22.04.2026 | 1.350 | 1.143 | 0,17 |
| 7,625 % fällig am 22.04.2046 | 50 | 40 | 0,01 |
| 8,280 % fällig am 31.12.2033 | 1.122 | 941 | 0,14 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | |
| 9,950 % fällig am 09.06.2021 | 350 | 319 | 0,05 |
| 10,875 % fällig am 26.01.2021 | 600 | 575 | 0,08 |
| **Provincia de la Rioja** | | | |
| 9,750 % fällig am 24.02.2025 | 400 | 310 | 0,04 |
| **Provincia de Neuquen** | | | |
| 7,500 % fällig am 27.04.2025 | 310 | 262 | 0,04 |
| Summe Argentinien | | 32.040 | 4,70 |
| **ÖSTERREICH** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Sappi Papier Holding GmbH** | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2026 | € 300 | 352 | 0,05 |
| **ASERBAIDSCHAN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Southern Gas Corridor CJSC** | | | |
| 6,875 % fällig am 24.03.2026 | $ 10.600 | 12.317 | 1,81 |
| **BAHAMAS** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Bahamas Government International Bond** | | | |
| 6,000 % fällig am 21.11.2028 | 2.950 | 3.197 | 0,47 |
| **BRASILIEN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais** | | | |
| 5,333 % fällig am 15.02.2028 | 15.129 | 15.659 | 2,30 |
| **Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.** | | | |
| 0,000 % fällig am 29.07.2019 (c)(e) | 1.233 | 13 | 0,00 |
| | | 15.672 | 2,30 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Brazil Government International Bond** | | | |
| 5,000 % fällig am 27.01.2045 | 5.470 | 5.424 | 0,80 |
| 5,625 % fällig am 07.01.2041 | 1.400 | 1.504 | 0,22 |
| | | 6.928 | 1,02 |
| Summe Brasilien | | 22.600 | 3,32 |
| **KAMERUN** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Cameroon Government International Bond** | | | |
| 9,500 % fällig am 19.11.2025 | 500 | 544 | 0,08 |
| **CAYMAN INSELN** | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.** | | | |
| 3,512 % fällig am 20.04.2027 | 250 | 249 | 0,04 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.** | | | |
| 0,000 % fällig am 05.06.2034 (c) | $ 2.700 | $ 1.829 | 0,27 |
| **China Evergrande Group** | | | |
| 8,250 % fällig am 23.03.2022 | 1.300 | 1.257 | 0,18 |
| 8,750 % fällig am 28.06.2025 | 200 | 178 | 0,03 |
| 9,500 % fällig am 11.04.2022 | 900 | 894 | 0,13 |
| **Fab Sukuk Co. Ltd.** | | | |
| 3,625 % fällig am 05.03.2023 | 500 | 514 | 0,08 |
| **Lima Metro Line Finance Ltd.** | | | |
| 5,875 % fällig am 05.07.2034 | 700 | 746 | 0,11 |
| **MAF Sukuk Ltd.** | | | |
| 4,638 % fällig am 14.05.2029 | 1.600 | 1.666 | 0,24 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | 2.000 | 1.990 | 0,29 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % bar und 1,000 % PIK)** | | | |
| 7,350 % fällig am 01.12.2026 (b) | 1.780 | 1.109 | 0,16 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 | 1.402 | 1.353 | 0,20 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | 1.500 | 1.530 | 0,22 |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | 2.300 | 2.306 | 0,34 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | 1.300 | 1.303 | 0,19 |
| **SPARC EM SPC Panama Metro Line SP** | | | |
| 0,000 % fällig am 05.12.2022 (c) | 1.110 | 1.055 | 0,16 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 | 1.900 | 1.901 | 0,28 |
| 8,375 % fällig am 15.01.2021 | 1.500 | 1.553 | 0,23 |
| **Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.** | | | |
| 3,750 % fällig am 23.01.2023 | 600 | 603 | 0,09 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | |
| 3,975 % fällig am 11.04.2029 | 8.800 | 9.206 | 1,35 |
| | | 30.993 | 4,55 |
| Summe Cayman Inseln | | 31.242 | 4,59 |
| **CHILE** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Corp. Nacional del Cobre de Chile** | | | |
| 4,250 % fällig am 17.07.2042 | 2.100 | 2.201 | 0,32 |
| 4,500 % fällig am 16.09.2025 | 2.600 | 2.826 | 0,42 |
| 4,875 % fällig am 04.11.2044 | 2.200 | 2.513 | 0,37 |
| **Empresa Nacional de Telecomunicaciones S.A.** | | | |
| 4,875 % fällig am 30.10.2024 | 800 | 846 | 0,12 |
| **GNL Quintero S.A.** | | | |
| 4,634 % fällig am 31.07.2029 | 900 | 956 | 0,14 |
| **Latam Airlines Pass-Through Trust** | | | |
| 4,200 % fällig am 15.08.2029 | 2.354 | 2.389 | 0,35 |
| 4,500 % fällig am 15.08.2025 | 464 | 462 | 0,07 |
| **Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.** | | | |
| 4,250 % fällig am 07.05.2029 | 1.600 | 1.691 | 0,25 |
| Summe Chile | | 13.884 | 2,04 |
| **CHINA** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **CCCI Treasure Ltd.** | | | |
| 3,500 % fällig am 21.04.2020 (e) | 900 | 901 | 0,13 |
| **China Construction Bank Corp.** | | | |
| 3,875 % fällig am 13.05.2025 (g) | 100 | 101 | 0,01 |
| **CNAC HK Finbridge Co. Ltd.** | | | |
| 3,500 % fällig am 19.07.2022 | 600 | 604 | 0,09 |
| **Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.** | | | |
| 3,125 % fällig am 27.07.2021 | 2.000 | 2.009 | 0,30 |
| 4,200 % fällig am 27.07.2026 | 800 | 835 | 0,12 |
| **SF Holding Investment Ltd.** | | | |
| 4,125 % fällig am 26.07.2023 | 3.000 | 3.129 | 0,46 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | |
| 3,900 % fällig am 17.05.2022 | 2.100 | 2.170 | 0,32 |
| | | 9.749 | 1,43 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Export-Import Bank of China** | | | |
| 2,875 % fällig am 26.04.2026 | 4.900 | 4.898 | 0,72 |
| Summe China | | 14.647 | 2,15 |
| **KOLUMBIEN** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **Ecopetrol S.A.** | | | |
| 5,375 % fällig am 26.06.2026 | $ 1.700 | $ 1.877 | 0,28 |
| 5,875 % fällig am 28.05.2045 | 1.800 | 1.997 | 0,29 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2043 | 700 | 900 | 0,13 |
| | | 4.774 | 0,70 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Colombia Government International Bond** | | | |
| 2,625 % fällig am 15.03.2023 | 650 | 648 | 0,09 |
| 3,875 % fällig am 25.04.2027 | 1.000 | 1.044 | 0,15 |
| 4,500 % fällig am 28.01.2026 | 1.000 | 1.081 | 0,16 |
| 4,500 % fällig am 15.03.2029 | 800 | 875 | 0,13 |
| 5,000 % fällig am 15.06.2045 | 1.800 | 1.991 | 0,29 |
| 5,200 % fällig am 15.05.2049 | 300 | 341 | 0,05 |
| 6,125 % fällig am 18.01.2041 | 200 | 248 | 0,04 |
| 7,375 % fällig am 18.09.2037 | 1.650 | 2.250 | 0,33 |
| 8,125 % fällig am 21.05.2024 | 500 | 617 | 0,09 |
| 10,375 % fällig am 28.01.2033 | 800 | 1.262 | 0,19 |
| | | 10.357 | 1,52 |
| Summe Kolumbien | | 15.131 | 2,22 |
| **COSTA RICA** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Costa Rica Government International Bond** | | | |
| 5,625 % fällig am 30.04.2043 | 3.300 | 2.867 | 0,42 |
| **DOMINIKANISCHE REPUBLIK** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Dominican Republic International Bond** | | | |
| 5,500 % fällig am 27.01.2025 | 5.500 | 5.864 | 0,86 |
| 5,875 % fällig am 18.04.2024 | 400 | 429 | 0,06 |
| 5,950 % fällig am 25.01.2027 | 2.600 | 2.811 | 0,41 |
| 6,000 % fällig am 19.07.2028 | 5.900 | 6.387 | 0,94 |
| 6,400 % fällig am 05.06.2049 | 1.800 | 1.888 | 0,28 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2048 | 1.200 | 1.272 | 0,19 |
| 6,850 % fällig am 27.01.2045 | 500 | 548 | 0,08 |
| 6,875 % fällig am 29.01.2026 | 1.500 | 1.699 | 0,25 |
| 7,500 % fällig am 06.05.2021 | 1.333 | 1.407 | 0,21 |
| Summe Dominikanische Republik | | 22.305 | 3,28 |
| **ECUADOR** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Ecuador Government International Bond** | | | |
| 7,875 % fällig am 23.01.2028 | 4.300 | 4.268 | 0,63 |
| 9,625 % fällig am 02.06.2027 | 400 | 432 | 0,06 |
| 9,650 % fällig am 13.12.2026 | 700 | 760 | 0,11 |
| 10,750 % fällig am 31.01.2029 | 4.200 | 4.751 | 0,70 |
| Summe Ecuador | | 10.211 | 1,50 |
| **ÄGYPTEN** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Egypt Government International Bond** | | | |
| 4,750 % fällig am 11.04.2025 | € 900 | 1.050 | 0,15 |
| 4,750 % fällig am 16.04.2026 | 5.700 | 6.536 | 0,96 |
| 5,577 % fällig am 21.02.2023 | $ 1.800 | 1.833 | 0,27 |
| 5,625 % fällig am 16.04.2030 | € 1.500 | 1.675 | 0,25 |
| 6,125 % fällig am 31.01.2022 | $ 1.600 | 1.653 | 0,24 |
| 6,375 % fällig am 11.04.2031 | € 800 | 929 | 0,14 |
| 7,500 % fällig am 31.01.2027 | $ 1.100 | 1.176 | 0,17 |
| 7,600 % fällig am 01.03.2029 | 2.200 | 2.326 | 0,34 |
| 7,903 % fällig am 21.02.2048 | 200 | 203 | 0,03 |
| 8,500 % fällig am 31.01.2047 | 1.900 | 2.019 | 0,30 |
| Summe Ägypten | | 19.400 | 2,85 |
| **EL SALVADOR** | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **El Salvador Government International Bond** | | | |
| 5,875 % fällig am 30.01.2025 | 500 | 500 | 0,07 |
| 6,375 % fällig am 18.01.2027 | 1.100 | 1.101 | 0,16 |
| 7,625 % fällig am 21.09.2034 | 1.100 | 1.143 | 0,17 |
| 7,750 % fällig am 24.01.2023 | 110 | 118 | 0,02 |
| Summe El Salvador | | 2.862 | 0,42 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **GABUN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Gabon Government International Bond** | | | | |
| 6,375 % fällig am 12.12.2024 | $ | 517 | $ 513 | 0,08 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,180 % fällig am 07.12.2020 | € | 100 | 112 | 0,02 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 600 | 689 | 0,10 |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | | 500 | 578 | 0,08 |
| 3,700 % fällig am 30.05.2024 | $ | 600 | 584 | 0,09 |
| 3,715 % fällig am 16.11.2022 | | 600 | 580 | 0,08 |
| 3,950 % fällig am 27.02.2023 | | 1.000 | 1.004 | 0,15 |
| 5,000 % fällig am 14.02.2022 | | 500 | 516 | 0,08 |
| Summe Deutschland | | | 4.063 | 0,60 |
| **GHANA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ghana Government International Bond** | | | | |
| 7,875 % fällig am 07.08.2023 | | 1.426 | 1.550 | 0,23 |
| 7,875 % fällig am 26.03.2027 | | 1.500 | 1.582 | 0,23 |
| 8,125 % fällig am 26.03.2032 | | 2.400 | 2.445 | 0,36 |
| 8,950 % fällig am 26.03.2051 | | 2.700 | 2.803 | 0,41 |
| Summe Ghana | | | 8.380 | 1,23 |
| **GUATEMALA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Guatemala Government International Bond** | | | | |
| 4,375 % fällig am 05.06.2027 | | 1.600 | 1.602 | 0,24 |
| 4,500 % fällig am 03.05.2026 | | 1.100 | 1.114 | 0,16 |
| 4,875 % fällig am 13.02.2028 | | 700 | 724 | 0,11 |
| 4,900 % fällig am 01.06.2030 | | 1.000 | 1.030 | 0,15 |
| 5,750 % fällig am 06.06.2022 | | 6.270 | 6.688 | 0,98 |
| 6,125 % fällig am 01.06.2050 | | 1.600 | 1.682 | 0,25 |
| Summe Guatemala | | | 12.840 | 1,89 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bright Food Singapore Holdings Pte Ltd.** | | | | |
| 1,375 % fällig am 19.06.2024 | € | 1.300 | 1.498 | 0,22 |
| **Huaneng Hong Kong Capital Ltd.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 30.10.2022 (e) | $ | 2.000 | 1.961 | 0,29 |
| Summe Hongkong | | | 3.459 | 0,51 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 03.07.2029 (a) | | 1.500 | 1.524 | 0,22 |
| **Delhi International Airport Ltd.** | | | | |
| 6,450 % fällig am 04.06.2029 | | 1.300 | 1.373 | 0,20 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 5,700 % fällig am 27.02.2022 | | 1.600 | 1.624 | 0,24 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.01.2022 | | 700 | 716 | 0,11 |
| | | | 5.237 | 0,77 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 3,375 % fällig am 05.08.2026 | | 900 | 903 | 0,13 |
| 3,875 % fällig am 01.02.2028 | | 2.100 | 2.159 | 0,32 |
| | | | 3.062 | 0,45 |
| Summe Indien | | | 8.299 | 1,22 |
| **INDONESIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bank Mandiri Persero Tbk PT** | | | | |
| 3,750 % fällig am 11.04.2024 | | 2.000 | 2.041 | 0,30 |
| **Indonesia Asahan Aluminium Persero PT** | | | | |
| 5,230 % fällig am 15.11.2021 | | 700 | 738 | 0,11 |
| 5,710 % fällig am 15.11.2023 | | 1.000 | 1.098 | 0,16 |
| 6,530 % fällig am 15.11.2028 | | 700 | 828 | 0,12 |
| **Pelabuhan Indonesia Persero PT** | | | | |
| 4,500 % fällig am 02.05.2023 | | 5.000 | 5.231 | 0,77 |
| 4,875 % fällig am 01.10.2024 | $ | 2.600 | $ 2.787 | 0,41 |
| **Pelabuhan Indonesia PT** | | | | |
| 4,250 % fällig am 05.05.2025 | | 3.700 | 3.848 | 0,56 |
| **Pertamina Persero PT** | | | | |
| 4,875 % fällig am 03.05.2022 | | 1.600 | 1.689 | 0,25 |
| 6,000 % fällig am 03.05.2042 | | 5.400 | 6.225 | 0,91 |
| **Perusahaan Listrik Negara PT** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.05.2027 | | 2.000 | 2.046 | 0,30 |
| 6,250 % fällig am 25.01.2049 | | 1.000 | 1.197 | 0,18 |
| | | | 27.728 | 4,07 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 2,625 % fällig am 14.06.2023 | € | 100 | 123 | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 15.04.2023 | $ | 2.100 | 2.140 | 0,31 |
| 3,375 % fällig am 30.07.2025 | € | 100 | 129 | 0,02 |
| 4,100 % fällig am 24.04.2028 | $ | 1.000 | 1.057 | 0,16 |
| 4,450 % fällig am 11.02.2024 | | 2.200 | 2.339 | 0,34 |
| 4,750 % fällig am 08.01.2026 | | 4.500 | 4.905 | 0,72 |
| 4,750 % fällig am 18.07.2047 | | 3.000 | 3.249 | 0,48 |
| 5,125 % fällig am 15.01.2045 | | 1.200 | 1.354 | 0,20 |
| 5,375 % fällig am 17.10.2023 | | 3.000 | 3.296 | 0,48 |
| 5,875 % fällig am 15.01.2024 | | 500 | 561 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 17.02.2037 | | 1.120 | 1.460 | 0,21 |
| 6,750 % fällig am 15.01.2044 | | 7.700 | 10.544 | 1,55 |
| 7,750 % fällig am 17.01.2038 | | 180 | 261 | 0,04 |
| 8,500 % fällig am 12.10.2035 | | 1.510 | 2.278 | 0,34 |
| **Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia** | | | | |
| 3,875 % fällig am 06.04.2024 | | 800 | 826 | 0,12 |
| **Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia** | | | | |
| 4,400 % fällig am 01.03.2028 | | 2.200 | 2.346 | 0,34 |
| 4,450 % fällig am 20.02.2029 | | 1.700 | 1.823 | 0,27 |
| | | | 38.691 | 5,68 |
| Summe Indonesien | | | 66.419 | 9,75 |
| **IRLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € | 3.700 | 4.265 | 0,63 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | |
| 3,373 % fällig am 15.11.2025 | $ | 200 | 203 | 0,03 |
| **Russian Railways via RZD Capital PLC** | | | | |
| 7,487 % fällig am 25.03.2031 | £ | 1.400 | 2.212 | 0,32 |
| **Vnesheconombank Via VEB Finance PLC** | | | | |
| 6,025 % fällig am 05.07.2022 | $ | 2.600 | 2.741 | 0,40 |
| 6,800 % fällig am 22.11.2025 | | 800 | 882 | 0,13 |
| | | | 10.303 | 1,51 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (f)** | | 46.530 | 4.722 | 0,69 |
| **INVESTMENTFONDS** | | | | |
| **PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (f)** | | 18.388 | 214 | 0,03 |
| Summe Irland | | | 15.239 | 2,23 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **INSEL MAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **NE Property BV** | | | | |
| 2,625 % fällig am 22.05.2023 | € | 700 | 819 | 0,12 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Delek & Avner Tamar Bond Ltd.** | | | | |
| 5,082 % fällig am 30.12.2023 | $ | 400 | 412 | 0,06 |
| 5,412 % fällig am 30.12.2025 | | 920 | 955 | 0,14 |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 14.08.2028 | | 600 | 626 | 0,09 |
| 6,875 % fällig am 21.06.2023 | | 900 | 1.023 | 0,15 |
| | | | 3.016 | 0,44 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 4,125 % fällig am 17.01.2048 | $ | 800 | $ 878 | 0,13 |
| Summe Israel | | | 3.894 | 0,57 |
| **ELFENBEINKÜSTE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ivory Coast Government International Bond** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.06.2025 | € | 1.100 | 1.310 | 0,19 |
| 5,250 % fällig am 22.03.2030 | | 1.100 | 1.228 | 0,18 |
| 5,375 % fällig am 23.07.2024 | $ | 600 | 607 | 0,09 |
| 6,125 % fällig am 15.06.2033 | | 800 | 747 | 0,11 |
| 6,375 % fällig am 03.03.2028 | | 3.800 | 3.771 | 0,55 |
| Summe Elfenbeinküste | | | 7.663 | 1,12 |
| **JORDANIEN** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Jordan Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 31.01.2027 | | 500 | 508 | 0,07 |
| 6,125 % fällig am 29.01.2026 | | 500 | 520 | 0,08 |
| 7,375 % fällig am 10.10.2047 | | 1.500 | 1.552 | 0,23 |
| Summe Jordanien | | | 2.580 | 0,38 |
| **KASACHSTAN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **KazMunayGas National Co. JSC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.04.2025 | | 3.700 | 3.950 | 0,58 |
| 4,750 % fällig am 19.04.2027 | | 3.000 | 3.222 | 0,47 |
| | | | 7.172 | 1,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kazakhstan Government International Bond** | | | | |
| 1,550 % fällig am 09.11.2023 | € | 100 | 120 | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 14.10.2044 | $ | 600 | 692 | 0,10 |
| 6,500 % fällig am 21.07.2045 | | 400 | 555 | 0,08 |
| | | | 1.367 | 0,20 |
| Summe Kasachstan | | | 8.539 | 1,25 |
| **KENIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Kenya Government International Bond** | | | | |
| 6,875 % fällig am 24.06.2024 | | 1.300 | 1.387 | 0,20 |
| 7,000 % fällig am 22.05.2027 | | 3.300 | 3.453 | 0,51 |
| 7,250 % fällig am 28.02.2028 | | 700 | 727 | 0,11 |
| 8,250 % fällig am 28.02.2048 | | 300 | 313 | 0,04 |
| Summe Kenia | | | 5.880 | 0,86 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Sovereign Credit Opportunities S.A.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 30.09.2019 | € | 127 | 146 | 0,02 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(b) | $ | 855 | 411 | 0,06 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A. (9,000 % bar und 0,500 % PIK)** | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(b) | | 453 | 217 | 0,03 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 19.07.2022 | | 1.500 | 1.576 | 0,23 |
| 4,950 % fällig am 23.03.2027 | | 500 | 529 | 0,08 |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 3.400 | 3.629 | 0,53 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 5,717 % fällig am 16.06.2021 | | 500 | 521 | 0,08 |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 1.900 | 2.021 | 0,30 |
| | | | 8.904 | 1,31 |
| Summe Luxemburg | | | 9.050 | 1,33 |
| **MEXIKO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **America Movil S.A.B. de C.V.** | | | | |
| 6,450 % fällig am 05.12.2022 | MXN | 2.000 | 98 | 0,02 |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 27.06.2029 (e)(g) | $ | 900 | 911 | 0,13 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 10.03.2021 | $ | 200 | $ | 211 | 0,03 |
| 6,750 % fällig am 30.09.2022 | | 650 | | 709 | 0,10 |
| **Comision Federal de Electricidad** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 26.05.2021 | | 400 | | 413 | 0,06 |
| 4,875 % fällig am 15.01.2024 | | 250 | | 259 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 14.02.2042 | | 1.675 | | 1.772 | 0,26 |
| **Corp. GEO S.A.B. de C.V.** | | | | | |
| 8,875 % fällig am 25.09.2014 ^ | | 500 | | 0 | 0,00 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.01.2023 | | 7.100 | | 6.755 | 0,99 |
| 4,875 % fällig am 24.01.2022 | | 3.300 | | 3.300 | 0,49 |
| 5,350 % fällig am 12.02.2028 | | 2.100 | | 1.916 | 0,28 |
| 5,375 % fällig am 13.03.2022 | | 1.000 | | 1.013 | 0,15 |
| 5,500 % fällig am 21.01.2021 | | 700 | | 709 | 0,10 |
| 5,500 % fällig am 27.06.2044 | | 4.100 | | 3.293 | 0,48 |
| 5,625 % fällig am 23.01.2046 | | 1.200 | | 973 | 0,14 |
| 6,350 % fällig am 12.02.2048 | | 4.575 | | 3.945 | 0,58 |
| 6,375 % fällig am 23.01.2045 | | 900 | | 777 | 0,12 |
| 6,500 % fällig am 13.03.2027 | | 100 | | 99 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 02.06.2041 | | 6.300 | | 5.604 | 0,82 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2035 | | 1.200 | | 1.114 | 0,16 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2038 | | 130 | | 117 | 0,02 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | | 3.100 | | 2.768 | 0,41 |
| 6,875 % fällig am 04.08.2026 | | 800 | | 812 | 0,12 |
| **Trust F** | | | | | |
| 4,869 % fällig am 15.01.2030 | | 1.100 | | 1.109 | 0,16 |
| 6,390 % fällig am 15.01.2050 | | 1.000 | | 1.027 | 0,15 |
| | | | | 39.704 | 5,83 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Mexico Government International Bond** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 22.04.2023 | € | 100 | | 124 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 15.03.2115 | | 1.900 | | 2.202 | 0,32 |
| 4,500 % fällig am 22.04.2029 | $ | 1.000 | | 1.074 | 0,16 |
| 4,600 % fällig am 23.01.2046 | | 4.441 | | 4.554 | 0,67 |
| 4,600 % fällig am 10.02.2048 | | 1.000 | | 1.033 | 0,15 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2044 | | 200 | | 209 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 12.10.2110 | | 3.800 | | 4.161 | 0,61 |
| 6,050 % fällig am 11.01.2040 | | 3.408 | | 4.076 | 0,60 |
| | | | | 17.433 | 2,56 |
| Summe Mexiko | | | | 57.137 | 8,39 |
| **MONGOLEI** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Mongolia Government International Bond** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.05.2023 | | 1.800 | | 1.835 | 0,27 |
| **MAROKKO** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **OCP S.A.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 25.04.2024 | | 700 | | 755 | 0,11 |
| **NAMIBIA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Namibia Government International Bond** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.10.2025 | | 1.000 | | 1.007 | 0,15 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **CIMPOR Financial Operations BV** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 17.07.2024 | | 1.100 | | 969 | 0,14 |
| **Kazakhstan Temir Zholy Finance BV** | | | | | |
| 6,950 % fällig am 10.07.2042 | | 2.400 | | 2.989 | 0,44 |
| **Metinvest BV** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 23.04.2023 | | 600 | | 622 | 0,09 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | | 200 | | 208 | 0,03 |
| Summe Niederlande | | | | 4.788 | 0,70 |
| **NIGERIA** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Nigeria Government International Bond** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 27.06.2022 | | 800 | | 828 | 0,12 |
| 6,500 % fällig am 28.11.2027 | | 2.100 | | 2.108 | 0,31 |
| 7,143 % fällig am 23.02.2030 | | 2.300 | | 2.332 | 0,34 |
| 7,625 % fällig am 21.11.2025 | $ | 4.700 | $ | 5.144 | 0,76 |
| 7,875 % fällig am 16.02.2032 | | 1.100 | | 1.153 | 0,17 |
| 8,747 % fällig am 21.01.2031 | | 2.400 | | 2.678 | 0,39 |
| 9,248 % fällig am 21.01.2049 | | 1.600 | | 1.815 | 0,27 |
| Summe Nigeria | | | | 16.058 | 2,36 |
| **OMAN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Oman Sovereign Sukuk SAOC** | | | | | |
| 5,932 % fällig am 31.10.2025 | | 500 | | 507 | 0,07 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Oman Government International Bond** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 08.03.2027 | | 2.100 | | 1.977 | 0,29 |
| 5,625 % fällig am 17.01.2028 | | 3.800 | | 3.613 | 0,53 |
| 6,500 % fällig am 08.03.2047 | | 2.400 | | 2.080 | 0,31 |
| | | | | 7.670 | 1,13 |
| Summe Oman | | | | 8.177 | 1,20 |
| **PAKISTAN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Third Pakistan International Sukuk Co. Ltd.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 13.10.2021 | | 1.300 | | 1.315 | 0,19 |
| 5,625 % fällig am 05.12.2022 | | 200 | | 202 | 0,03 |
| | | | | 1.517 | 0,22 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Pakistan Government International Bond** | | | | | |
| 6,875 % fällig am 05.12.2027 | | 300 | | 304 | 0,05 |
| Summe Pakistan | | | | 1.821 | 0,27 |
| **PANAMA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 18.11.2048 | | 1.300 | | 1.538 | 0,22 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Panama Government International Bond** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2047 | | 1.000 | | 1.132 | 0,17 |
| 4,500 % fällig am 16.04.2050 | | 1.000 | | 1.124 | 0,16 |
| 8,125 % fällig am 28.04.2034 | | 1.000 | | 1.421 | 0,21 |
| 8,875 % fällig am 30.09.2027 | | 1.250 | | 1.774 | 0,26 |
| 9,375 % fällig am 16.01.2023 | | 180 | | 220 | 0,03 |
| 9,375 % fällig am 01.04.2029 | | 300 | | 451 | 0,07 |
| | | | | 6.122 | 0,90 |
| Summe Panama | | | | 7.660 | 1,12 |
| **PARAGUAY** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Paraguay Government International Bond** | | | | | |
| 4,700 % fällig am 27.03.2027 | | 800 | | 868 | 0,13 |
| 6,100 % fällig am 11.08.2044 | | 1.000 | | 1.194 | 0,17 |
| Summe Paraguay | | | | 2.062 | 0,30 |
| **PERU** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Peru LNG SRL** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 22.03.2030 | | 300 | | 324 | 0,05 |
| **Petroleos del Peru S.A.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 19.06.2047 | | 1.200 | | 1.368 | 0,20 |
| **Union Andina de Cementos S.A.A.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.10.2021 | | 150 | | 155 | 0,02 |
| | | | | 1.847 | 0,27 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Fondo MIVIVIENDA S.A.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 200 | | 204 | 0,03 |
| **Peru Government International Bond** | | | | | |
| 6,550 % fällig am 14.03.2037 | | 1.690 | | 2.391 | 0,35 |
| 8,750 % fällig am 21.11.2033 | | 1.900 | | 3.073 | 0,45 |
| | | | | 5.668 | 0,83 |
| Summe Peru | | | | 7.515 | 1,10 |
| **PHILIPPINEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Power Sector Assets & Liabilities Management Corp.** | | | | | |
| 7,390 % fällig am 02.12.2024 | $ | 1.700 | $ | 2.079 | 0,30 |
| **KATAR** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Qatar Government International Bond** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.03.2024 | | 3.900 | | 4.035 | 0,60 |
| 4,000 % fällig am 14.03.2029 | | 3.800 | | 4.102 | 0,60 |
| 4,817 % fällig am 14.03.2049 | | 3.800 | | 4.364 | 0,64 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | | 800 | | 955 | 0,14 |
| Summe Katar | | | | 13.456 | 1,98 |
| **RUMÄNIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Romania Government International Bond** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 26.05.2028 | € | 100 | | 127 | 0,02 |
| **RUSSLAND** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Russia Government International Bond** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 2.800 | | 2.907 | 0,43 |
| 5,100 % fällig am 28.03.2035 | | 5.000 | | 5.440 | 0,80 |
| 5,625 % fällig am 04.04.2042 | | 5.000 | | 5.875 | 0,86 |
| Summe Russland | | | | 14.222 | 2,09 |
| **SENEGAL** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Senegal Government International Bond** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 13.03.2028 | € | 400 | | 458 | 0,07 |
| 6,250 % fällig am 23.05.2033 | $ | 900 | | 873 | 0,13 |
| 6,750 % fällig am 13.03.2048 | | 600 | | 565 | 0,08 |
| Summe Senegal | | | | 1.896 | 0,28 |
| **SERBIEN** | | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 26.06.2029 | € | 3.800 | | 4.327 | 0,64 |
| 4,875 % fällig am 25.02.2020 | $ | 827 | | 838 | 0,12 |
| Summe Serbien | | | | 5.165 | 0,76 |
| **SINGAPUR** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 1.300 | | 1.298 | 0,19 |
| **United Overseas Bank Ltd.** | | | | | |
| 2,880 % fällig am 08.03.2027 (g) | | 200 | | 200 | 0,03 |
| Summe Singapur | | | | 1.498 | 0,22 |
| **SÜDAFRIKA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AngloGold Ashanti Holdings PLC** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.04.2020 | | 300 | | 306 | 0,05 |
| **Eskom Holdings SOC Ltd.** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 26.01.2021 | | 1.500 | | 1.516 | 0,22 |
| 6,350 % fällig am 10.08.2028 | | 2.500 | | 2.711 | 0,40 |
| 6,750 % fällig am 06.08.2023 | | 1.500 | | 1.575 | 0,23 |
| **FirstRand Bank Ltd.** | | | | | |
| 6,250 % fällig am 23.04.2028 (g) | | 1.400 | | 1.467 | 0,22 |
| **Growthpoint Properties International Pty. Ltd.** | | | | | |
| 5,872 % fällig am 02.05.2023 | | 1.100 | | 1.161 | 0,17 |
| **Prosus NV** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 21.07.2025 | | 400 | | 437 | 0,06 |
| | | | | 9.173 | 1,35 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **South Africa Government International Bond** | | | | | |
| 4,665 % fällig am 17.01.2024 | | 3.000 | | 3.144 | 0,46 |
| 4,850 % fällig am 27.09.2027 | | 3.200 | | 3.303 | 0,49 |
| 5,000 % fällig am 12.10.2046 | | 2.000 | | 1.933 | 0,28 |
| 5,875 % fällig am 22.06.2030 | | 700 | | 761 | 0,11 |
| | | | | 9.141 | 1,34 |
| Summe Südafrika | | | | 18.314 | 2,69 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **SRI LANKA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **National Savings Bank** | | | | |
| 5,150 % fällig am 10.09.2019 | $ | 600 | $ 600 | 0,09 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Sri Lanka Government International Bond** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.01.2022 | | 400 | 402 | 0,06 |
| 6,125 % fällig am 03.06.2025 | | 200 | 195 | 0,03 |
| 6,200 % fällig am 11.05.2027 | | 1.400 | 1.330 | 0,19 |
| 6,250 % fällig am 04.10.2020 | | 2.800 | 2.838 | 0,42 |
| 6,250 % fällig am 27.07.2021 | | 400 | 406 | 0,06 |
| 6,825 % fällig am 18.07.2026 | | 800 | 799 | 0,12 |
| 6,850 % fällig am 03.11.2025 | | 400 | 402 | 0,06 |
| 7,850 % fällig am 14.03.2029 | | 700 | 724 | 0,10 |
| | | | 7.096 | 1,04 |
| Summe Sri Lanka | | | 7.696 | 1,13 |
| **ÜBERNATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banque Ouest Africaine de Developpement** | | | | |
| 5,000 % fällig am 27.07.2027 | | 800 | 828 | 0,12 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ghana Government International Bond** | | | | |
| 10,750 % fällig am 14.10.2030 | | 200 | 253 | 0,04 |
| Summe übernational | | | 1.081 | 0,16 |
| **TANSANIA** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Ministry of Finance of Tanzania** | | | | |
| 7,417 % - 7,763 % fällig am 23.06.2022 | | 1.457 | 1.455 | 0,22 |
| 7,741 % fällig am 10.12.2019 | | 1.900 | 1.913 | 0,28 |
| | | | 3.368 | 0,50 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Tanzania Government International Bond** | | | | |
| 8,688 % fällig am 09.03.2020 | | 689 | 703 | 0,10 |
| Summe Tansania | | | 4.071 | 0,60 |
| **THAILAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Thaioil Treasury Center Co. Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 20.11.2048 | | 800 | 969 | 0,14 |
| **TRINIDAD UND TOBAGO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Trinidad Petroleum Holdings Ltd.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 08.05.2022 | | 382 | 381 | 0,06 |
| **TÜRKEI** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** | | | | |
| 5,004 % fällig am 06.04.2023 | | 200 | 193 | 0,03 |
| 5,800 % fällig am 21.02.2022 | | 4.000 | 4.024 | 0,59 |
| **Turkish Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2028 | | 298 | 275 | 0,04 |
| **Turkiye Is Bankasi A/S** | | | | |
| 6,125 % fällig am 25.04.2024 | | 400 | 368 | 0,05 |
| | | | 4.860 | 0,71 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Akbank T.A.S.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 06.10.2019 | € | 1.000 | 1.136 | 0,17 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Credit Bank of Turkey** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.09.2022 | $ | 700 | 657 | 0,10 |
| 5,375 % fällig am 24.10.2023 | | 900 | 854 | 0,12 |
| 8,250 % fällig am 24.01.2024 | | 1.800 | 1.885 | 0,28 |
| **Turkey Government International Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 23.03.2023 | | 1.000 | 913 | 0,13 |
| 4,875 % fällig am 16.04.2043 | | 400 | 312 | 0,05 |
| 5,125 % fällig am 17.02.2028 | | 2.900 | 2.597 | 0,38 |
| 5,750 % fällig am 22.03.2024 | | 300 | 293 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 11.05.2047 | $ | 300 | $ 252 | 0,04 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2027 | | 8.500 | 8.100 | 1,19 |
| 6,000 % fällig am 14.01.2041 | | 600 | 520 | 0,08 |
| 6,125 % fällig am 24.10.2028 | | 3.200 | 3.024 | 0,44 |
| 6,750 % fällig am 30.05.2040 | | 3.200 | 3.001 | 0,44 |
| 6,875 % fällig am 17.03.2036 | | 4.030 | 3.872 | 0,57 |
| 7,250 % fällig am 23.12.2023 | | 6.000 | 6.212 | 0,91 |
| 7,250 % fällig am 05.03.2038 | | 200 | 199 | 0,03 |
| 7,625 % fällig am 26.04.2029 | | 900 | 924 | 0,14 |
| | | | 33.615 | 4,94 |
| Summe Türkei | | | 39.611 | 5,82 |
| **UKRAINE** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 0,000 % fällig am 31.05.2040 | | 3.800 | 2.735 | 0,40 |
| 6,750 % fällig am 20.06.2026 | € | 2.500 | 3.023 | 0,44 |
| 7,375 % fällig am 25.09.2032 | $ | 1.200 | 1.183 | 0,17 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2020 | | 3.800 | 3.930 | 0,58 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2021 | | 1.600 | 1.675 | 0,25 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2021 (i) | | 1.200 | 1.257 | 0,18 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2022 | | 3.400 | 3.608 | 0,53 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | | 1.000 | 1.061 | 0,16 |
| 7,750 % fällig am 01.09.2024 | | 3.000 | 3.137 | 0,46 |
| Summe Ukraine | | | 21.609 | 3,17 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DP World PLC** | | | | |
| 6,850 % fällig am 02.07.2037 | | 580 | 730 | 0,11 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | | 200 | 202 | 0,03 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | 932 | 0,14 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Afren PLC** | | | | |
| 0,112 % fällig am 25.04.2049 ^(h) | | 788 | 98 | 0,01 |
| 11,500 % fällig am 01.02.2016 ^ | | 282 | 2 | 0,00 |
| **State Savings Bank of Ukraine Via SSB PLC** | | | | |
| 9,375 % fällig am 10.03.2023 | | 80 | 84 | 0,01 |
| **Ukreximbank Via Biz Finance PLC** | | | | |
| 9,625 % fällig am 27.04.2022 | | 75 | 78 | 0,01 |
| Summe Großbritannien | | | 262 | 0,03 |
| **USA** | | | | |
| **FÖRDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Bayview Opportunity Master Fund Trust** | | | | |
| 4,213 % fällig am 29.10.2033 | | 221 | 223 | 0,03 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | | |
| 2,644 % fällig am 25.02.2037 | | 1.500 | 1.478 | 0,22 |
| 3,154 % fällig am 25.11.2035 | | 640 | 648 | 0,10 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 3,570 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 2.828 | 1.265 | 0,19 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.09.2036 | | 1.223 | 922 | 0,14 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.11.2036 | | 1.262 | 896 | 0,13 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 3,199 % fällig am 25.03.2034 | | 1.411 | 1.403 | 0,21 |
| **Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | | 288 | 279 | 0,04 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | | 332 | 230 | 0,03 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,924 % fällig am 25.09.2035 | | 1.000 | 893 | 0,13 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | | |
| 2,714 % fällig am 25.09.2047 | | 102 | 99 | 0,01 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.02.2037 | | 225 | 87 | 0,01 |
| 3,304 % fällig am 25.10.2037 | | 189 | 158 | 0,02 |
| | | | 8.581 | 1,26 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 2,200 % fällig am 09.01.2020 | $ | 100 | $ 100 | 0,01 |
| 5,550 % fällig am 04.05.2020 | | 100 | 102 | 0,02 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | | 1.200 | 1.350 | 0,20 |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 2.308 | 2.582 | 0,38 |
| 9,750 % fällig am 06.01.2027 | | 2.243 | 2.585 | 0,38 |
| | | | 6.719 | 0,99 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | | |
| 3,054 % fällig am 25.10.2036 | | 162 | 133 | 0,02 |
| **Civic Mortgage LLC** | | | | |
| 4,349 % fällig am 25.11.2022 | | 141 | 142 | 0,02 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.05.2036 ^ | | 174 | 107 | 0,02 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | | |
| 2,977 % fällig am 30.11.2037 | | 600 | 545 | 0,08 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.02.2037 | | 448 | 411 | 0,06 |
| 3,044 % fällig am 25.07.2045 | | 98 | 93 | 0,01 |
| 3,856 % fällig am 25.11.2037 | | 417 | 409 | 0,06 |
| **JPMorgan Resecuritization Trust** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.03.2056 | | 107 | 104 | 0,01 |
| **Lehman XS Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 | | 398 | 392 | 0,06 |
| 2,654 % fällig am 25.08.2037 | | 2.162 | 2.138 | 0,31 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 25.02.2037 | | 1.005 | 974 | 0,14 |
| **SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,316 % fällig am 25.10.2037 ^ | | 182 | 174 | 0,03 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 4,229 % fällig am 25.03.2036 | | 534 | 523 | 0,08 |
| | | | 6.145 | 0,90 |
| Summe USA | | | 21.445 | 3,15 |
| **URUGUAY** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Uruguay Government International Bond** | | | | |
| 4,375 % fällig am 27.10.2027 | | 851 | 922 | 0,13 |
| 4,375 % fällig am 23.01.2031 | | 2.949 | 3.197 | 0,47 |
| 4,975 % fällig am 20.04.2055 | | 800 | 885 | 0,13 |
| 5,100 % fällig am 18.06.2050 | | 1.700 | 1.917 | 0,28 |
| 7,625 % fällig am 21.03.2036 | | 1.080 | 1.543 | 0,23 |
| 7,875 % fällig am 15.01.2033 | | 2.730 | 3.926 | 0,58 |
| Summe Uruguay | | | 12.390 | 1,82 |
| **VENEZUELA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 ^ | | 6.300 | 1.039 | 0,15 |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | | 1.400 | 224 | 0,04 |
| Summe Venezuela | | | 1.263 | 0,19 |
| **VIETNAM** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Vietnam Government International Bond** | | | | |
| 4,800 % fällig am 19.11.2024 | | 1.000 | 1.066 | 0,16 |
| **JUNGFERNINSELN (BRITISCH)** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 07.10.2020 | | 433 | 441 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 | | 600 | 627 | 0,09 |
| Summe Jungferninseln (Britisch) | | | 1.068 | 0,16 |
| **SAMBIA** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Zambia Government International Bond** | | | | |
| 8,500 % fällig am 14.04.2024 | | 400 | 271 | 0,04 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (I)** | | | | |
| | | | 556 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| JPMorgan Structured Products BV 17,053 % fällig am 21.11.2019 (c)(d)(h) | EGP | 5.800 | $ 328 | 0,05 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 884 | 0,13 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f) | | 2.233.169 | 22.365 | 3,29 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 665.019** | **97,66** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 314 | $ 1.010 | 0,15 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 15 | 14 | 0,00 |
| | | | | $ 1.024 | 0,15 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 1.024** | **0,15** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| General Electric Co. | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 100 | $ 5 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-30 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 35.100 | $ 96 | 0,02 |
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 21.900 | 228 | 0,03 |
| | | | | $ 324 | 0,05 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 12,285 % | 02.01.2025 | BRL 4.000 | $ 177 | 0,03 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 16,150 | 04.01.2021 | 11.710 | (340) | (0,05) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 1,500 | 21.06.2027 | $ 7.100 | 411 | 0,06 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | € 2.000 | (45) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | 1.600 | (88) | (0,01) |
| | | | | | $ 115 | 0,02 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 444** | **0,07** |

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

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

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

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

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

## VERKAUFSOPTIONEN

### CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs- kurs | Verfalls- datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 % | 18.09.2019 | 900 | $ (2) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 700 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (3) | $ 0 | 0,00 |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits- datum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämie | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Russia Government International Bond | (1,000) % | 20.06.2024 | $ 4.300 | $ 22 | $ 5 | $ 27 | 0,00 |

### CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits- datum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämie | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Brazil Government International Bond | 1,000 % | 20.06.2020 | $ 400 | $ (25) | $ 27 | $ 2 | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 300 | (16) | 19 | 3 | 0,00 |
| | Panama Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 1.900 | (22) | 58 | 36 | 0,01 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 200 | (8) | 10 | 2 | 0,00 |
| | Peru Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 5.000 | 63 | 61 | 124 | 0,02 |
| BPS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 400 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 500 | (35) | 28 | (7) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 900 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| BRC | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 1.000 | 0 | 13 | 13 | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.03.2024 | 200 | (28) | 29 | 1 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 600 | (43) | 43 | 0 | 0,00 |
| CBK | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.200 | (12) | 17 | 5 | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.03.2024 | 300 | (41) | 43 | 2 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 600 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2027 | 5.500 | (322) | 26 | (296) | (0,04) |
| DUB | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 200 | (11) | 13 | 2 | 0,00 |
| | Egypt Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 800 | (23) | 16 | (7) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2019 | 300 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | Penerbangan Malaysia Bhd. | 1,000 | 20.03.2020 | 300 | (3) | 5 | 2 | 0,00 |
| FBF | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 200 | (11) | 13 | 2 | 0,00 |
| | Ecuador Government International Bond | 5,000 | 20.06.2021 | 300 | (19) | 20 | 1 | 0,00 |
| | Egypt Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 1.600 | (136) | 80 | (56) | (0,01) |
| GST | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 200 | (13) | 14 | 1 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.400 | (46) | 14 | (32) | 0,00 |
| | Indonesia Government International Bond | 1,000 | 20.03.2024 | 200 | (27) | 28 | 1 | 0,00 |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.09.2019 | 3.900 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.09.2020 | 5.000 | (415) | 436 | 21 | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.03.2020 | 5.000 | (101) | 131 | 30 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 1.100 | (17) | 17 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.500 | (24) | 17 | (7) | 0,00 |
| JPM | Panama Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 3.800 | (41) | 114 | 73 | 0,01 |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 4.200 | (265) | (92) | (357) | (0,05) |
| MYC | Panama Government International Bond | 1,000 | 20.06.2022 | 1.200 | (9) | 35 | 26 | 0,00 |
| | | | | | $ (1.638) | $ 1.236 | $ (402) | (0,06) |

[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 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.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | € | 3.200 | $ | 3.589 | $ 0 | $ (55) | $ (55) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 595 | € | 531 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 1.542 | RUB | 100.658 | 44 | 0 | 44 | 0,01 |
| | 09/2019 | CNY | 1.355 | $ | 196 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € | 27.480 | | 30.733 | 0 | (562) | (562) | (0,08) |
| CBK | 07/2019 | | 3.016 | | 3.434 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 1.698 | | 2.150 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 39.097 | € | 34.401 | 79 | 0 | 79 | 0,01 |
| | 08/2019 | € | 34.401 | $ | 39.197 | 0 | (79) | (79) | (0,01) |
| | 08/2019 | MXN | 745 | | 37 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | € | 17 | | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.094 | € | 5.355 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 2.953 | CNH | 20.517 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 477 | EGP | 8.744 | 37 | 0 | 37 | 0,01 |
| JPM | 07/2019 | € | 1.236 | $ | 1.385 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| MSB | 07/2019 | BRL | 7.628 | | 1.990 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.984 | BRL | 7.628 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 1.893 | | 7.628 | 99 | 0 | 99 | 0,01 |
| | | | | | | $ 304 | $ (733) | $ (429) | (0,06) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 128.105 | $ | 145.578 | $ 0 | $ (308) | $ (308) | (0,05) |
| | 08/2019 | $ | 145.949 | € | 128.105 | 309 | 0 | 309 | 0,05 |
| BPS | 07/2019 | € | 121.770 | $ | 138.452 | 0 | (219) | (219) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 763 | € | 678 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 138.805 | | 121.770 | 221 | 0 | 221 | 0,03 |
| BRC | 07/2019 | | 139.174 | | 124.442 | 2.540 | 0 | 2.540 | 0,37 |
| CBK | 07/2019 | € | 133.126 | $ | 151.301 | 0 | (303) | (303) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 747 | € | 658 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 145.962 | | 128.105 | 296 | 0 | 296 | 0,04 |
| GLM | 07/2019 | | 3.225 | | 2.886 | 61 | 0 | 61 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | | 134.504 | | 120.286 | 2.478 | 0 | 2.478 | 0,36 |
| RYL | 07/2019 | | 853 | | 754 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 4.094 | | 3.632 | 42 | 0 | 42 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | | 224 | | 201 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 139.152 | | 124.442 | 2.563 | 0 | 2.563 | 0,38 |
| | | | | | | $ 8.531 | $ (830) | $ 7.701 | 1,13 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Investor NOK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 4 | NOK | 32 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 260 | | 2.284 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | NOK | 2.409 | $ | 283 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 283 | NOK | 2.409 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | NOK | 2.404 | $ | 283 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 283 | NOK | 2.404 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 268 | | 2.348 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 268 | | 2.348 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | | | | | | $ 23 | $ (2) | $ 21 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Investor SEK (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 71 | SEK | 677 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | SEK | 97 | $ | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | $ | 562 | SEK | 5.356 | 15 | 0 | 15 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | SEK | 145 | $ | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | | 645 | | 70 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 19 | SEK | 182 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| IND | 07/2019 | | 640 | | 6.130 | 21 | 0 | 21 | 0,01 |
| JPM | 07/2019 | SEK | 6.005 | $ | 647 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 649 | SEK | 6.005 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 22 | | 208 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | SEK | 387 | $ | 41 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 13 | SEK | 127 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SCX | 07/2019 | SEK 5.931 | $ 640 | $ 1 | $ 0 | $ 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 641 | SEK 6.130 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 08/2019 | 641 | 5.931 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | SEK 974 | $ 103 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 103 | SEK 967 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | SEK 51 | $ 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 60 | $ (3) | $ 57 | 0,01 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 6.975** | **1,02** |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 2,980 % fällig am 25.10.2019 | $ 1.800 | $ 1.802 | 0,27 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 1.802** | **0,27** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 675.264** | **99,17** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ 5.660** | **0,83** |
| **Nettovermögen** | | **$ 680.924** | **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) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Eingeschränkte Wertpapiere

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeits-datum | Kaufdatum | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Afren PLC | 0,112 % | 25.04.2049 | 30.04.2015 | $ 761 | $ 98 | 0,01 |
| JPMorgan Structured Products BV | 17,053 | 25.04.2049 | 21.02.2019 | 312 | 328 | 0,05 |
| | | | | $ 1.073 | $ 426 | 0,06 |

(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 2.199 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 8.786 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 920 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 556 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | $ (567) | $ 556 | $ 556 | 0,08 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (567)** | **$ 556** | **$ 556** | **0,08** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 27.301 | $ 634.106 | $ 3.612 | $ 665.019 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.802 | 0 | 1.802 |
| Finanzderivate[3] | 1.024 | 7.419 | 0 | 8.443 |
| **Summen** | **$ 28.325** | **$ 643.327** | **$ 3.612** | **$ 675.264** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 43.896 | $ 485.537 | $ 2.099 | $ 531.532 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.801 | 0 | 1.801 |
| Finanzderivate[3] | 1.051 | (326) | 0 | 725 |
| **Summen** | **$ 44.947** | **$ 487.012** | **$ 2.099** | **$ 534.058** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kredit-betrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| MEI | 2,450 % | 15.02.2019 | TBD[1] | $ (1.767) | $ (1.784) | (0,26) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (1.784)** | **(0,26)** |

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 170 | $ 0 | $ 170 |
| BPS | 11 | 0 | 11 |
| BRC | 1.992 | (1.820) | 172 |
| CBK | (262) | 480 | 218 |
| DUB | (2) | (10) | (12) |
| FBF | (53) | 0 | (53) |
| GLM | 61 | 0 | 61 |
| GST | (30) | 0 | (30) |
| HUS | 122 | 0 | 122 |
| IND | 21 | 0 | 21 |
| JPM | (300) | 440 | 140 |
| MSB | 1 | 0 | 1 |
| MYC | 26 | 0 | 26 |
| MYI | 2.478 | (2.260) | 218 |
| RYL | 5 | 0 | 5 |
| SCX | 169 | 0 | 169 |
| SSB | 3 | 0 | 3 |
| TOR | 2.563 | (2.620) | (57) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 81,93 | 80,96 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 15,65 | 15,92 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,08 | 0,05 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,15 | 0,19 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,07 | (0,02) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,02 | (0,04) |
| Einlagenzertifikate | 0,27 | 0,33 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,26) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Albanien | 0,12 | 0,15 |
| Argentinien | 4,70 | 5,88 |
| Österreich | 0,05 | 0,00 |
| Aserbaidschan | 1,81 | 1,68 |
| Bahamas | 0,47 | 0,51 |
| Brasilien | 3,32 | 4,22 |
| Kamerun | 0,08 | 0,09 |
| Cayman-Inseln | 4,59 | 2,03 |
| Chile | 2,04 | 2,18 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| China | 2,15 | 3,32 |
| Kolumbien | 2,22 | 1,97 |
| Costa Rica | 0,42 | 0,46 |
| Dominikanische Republik | 3,28 | 2,72 |
| Ecuador | 1,50 | 0,68 |
| Ägypten | 2,85 | 1,90 |
| El Salvador | 0,42 | 0,31 |
| Gabun | 0,08 | 0,09 |
| Deutschland | 0,60 | 0,02 |
| Ghana | 1,23 | 0,52 |
| Guatemala | 1,89 | 1,82 |
| Hongkong | 0,51 | 0,33 |
| Indien | 1,22 | 0,54 |
| Indonesien | 9,75 | 10,03 |
| Irland | 2,23 | 2,89 |
| Insel Man | 0,12 | 0,00 |
| Israel | 0,57 | 1,06 |
| Elfenbeinküste | 1,12 | 1,05 |
| Jordanien | 0,38 | 0,42 |
| Kasachstan | 1,25 | 1,13 |
| Kenia | 0,86 | 0,32 |
| Luxemburg | 1,33 | 2,53 |
| Mexiko | 8,39 | 8,44 |
| Mongolei | 0,27 | 0,31 |
| Marokko | 0,11 | 0,00 |
| Namibia | 0,15 | 0,16 |
| Niederlande | 0,70 | 0,75 |
| Nigeria | 2,36 | 0,00 |
| Oman | 1,20 | 1,25 |
| Pakistan | 0,27 | 0,31 |
| Panama | 1,12 | 0,99 |
| Paraguay | 0,30 | 0,33 |
| Peru | 1,10 | 1,28 |
| Philippinen | 0,30 | 0,34 |
| Polen | 0,00 | 0,22 |
| Katar | 1,98 | 0,38 |
| Rumänien | 0,02 | 0,02 |
| Russland | 2,09 | 0,93 |
| Senegal | 0,28 | 0,37 |
| Serbien | 0,76 | 0,37 |
| Singapur | 0,22 | 0,26 |
| Slowenien | 0,00 | 0,12 |
| Südafrika | 2,69 | 3,59 |
| Sri Lanka | 1,13 | 1,17 |
| Supranational | 0,16 | 0,25 |
| Tansania | 0,60 | 0,53 |
| Thailand | 0,14 | 0,22 |
| Trinidad und Tobago | 0,06 | 0,10 |
| Türkei | 5,82 | 7,07 |
| Ukraine | 3,17 | 2,32 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,14 | 0,15 |
| Großbritannien | 0,03 | 0,08 |
| Vereinigte Staaten | 3,15 | 3,99 |
| Uruguay | 1,82 | 1,61 |
| Venezuela | 0,19 | 0,48 |
| Vietnam | 0,16 | 0,19 |
| Jungferninseln (Britisch) | 0,16 | 0,29 |
| Sambia | 0,04 | 0,00 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,13 | 0,10 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 3,29 | 7,11 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,15 | 0,19 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,05 | (0,01) |
| Zinsswaps | 0,02 | (0,01) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,06) | (0,17) |
| Devisenterminkontrakte | (0,06) | (0,03) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,14 | 0,16 |
| Einlagenzertifikate | 0,27 | 0,33 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | 0,83 | 2,61 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | |
| 4,154 % fällig am 25.10.2023 | $ 77 | $ 77 | 0,00 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | |
| **ABN AMRO Bank NV** | | | |
| 2,450 % fällig am 04.06.2020 | 300 | 300 | 0,01 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | |
| 3,300 % fällig am 23.01.2023 | 200 | 202 | 0,01 |
| 4,125 % fällig am 03.07.2023 | 900 | 937 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 01.07.2020 | 2.150 | 2.182 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | 400 | 413 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | 4.200 | 4.308 | 0,15 |
| **Air Lease Corp.** | | | |
| 2,625 % fällig am 01.07.2022 | 800 | 800 | 0,03 |
| 4,750 % fällig am 01.03.2020 | 200 | 203 | 0,01 |
| **Aircastle Ltd.** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.03.2021 | 100 | 104 | 0,00 |
| 7,625 % fällig am 15.04.2020 | 400 | 415 | 0,01 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | 800 | 802 | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | 900 | 911 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 15.04.2021 | 200 | 204 | 0,01 |
| 7,500 % fällig am 15.09.2020 | 200 | 211 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2020 | 300 | 311 | 0,01 |
| **American Tower Corp.** | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2022 | 400 | 398 | 0,01 |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | 2.800 | 2.807 | 0,10 |
| 3,300 % fällig am 15.02.2021 | 300 | 304 | 0,01 |
| 3,450 % fällig am 15.09.2021 | 1.000 | 1.022 | 0,04 |
| 5,900 % fällig am 01.11.2021 | 100 | 108 | 0,00 |
| **Aroundtown S.A.** | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | 6.500 | 7.038 | 0,24 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € 1.500 | 1.840 | 0,06 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | |
| 7,125 % fällig am 15.10.2020 | $ 700 | 741 | 0,03 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | 100 | 107 | 0,00 |
| **AXA Equitable Holdings, Inc.** | | | |
| 3,900 % fällig am 20.04.2023 | 3.000 | 3.128 | 0,11 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | |
| 8,875 % fällig am 14.04.2021 (f)(g) | € 600 | 763 | 0,03 |
| **Banco Santander Chile** | | | |
| 3,380 % fällig am 25.07.2020 | $ 7.000 | 7.018 | 0,24 |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 3,552 % fällig am 23.07.2024 | 5.800 | 5.840 | 0,20 |
| **Bank of Ireland** | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (f)(g) | € 1.700 | 2.047 | 0,07 |
| **Barclays PLC** | | | |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | £ 500 | 655 | 0,02 |
| 3,905 % fällig am 16.05.2024 | $ 1.300 | 1.282 | 0,04 |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | 4.300 | 4.451 | 0,15 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | |
| 3,000 % fällig am 30.03.2020 | 200 | 200 | 0,01 |
| **BPCE S.A.** | | | |
| 3,743 % fällig am 22.05.2022 | 850 | 859 | 0,03 |
| **Capital One Financial Corp.** | | | |
| 3,295 % fällig am 12.05.2020 | 2.785 | 2.797 | 0,10 |
| **CDBL Funding** | | | |
| 3,768 % fällig am 15.11.2021 | 6.000 | 6.016 | 0,21 |
| **Citigroup, Inc.** | | | |
| 3,543 % fällig am 01.06.2024 | 9.300 | 9.356 | 0,32 |
| **CNH Industrial Capital LLC** | | | |
| 4,375 % fällig am 06.11.2020 | 2.500 | 2.552 | 0,09 |
| **Compass Bank** | | | |
| 2,750 % fällig am 29.09.2019 | 800 | 800 | 0,03 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | |
| 4,625 % fällig am 29.12.2025 (f)(g) | € 3.000 | 3.671 | 0,13 |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (f)(g) | 1.600 | 1.899 | 0,07 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (f)(g) | 2.200 | 2.779 | 0,10 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | |
| 7,125 % fällig am 27.01.2022 (j) | $ 3.100 | $ 3.274 | 0,11 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | € 2.400 | 2.775 | 0,10 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | |
| 3,423 % fällig am 10.06.2020 | $ 1.000 | 1.008 | 0,03 |
| 3,750 % fällig am 24.04.2023 | 2.800 | 2.908 | 0,10 |
| **Credit Suisse AG** | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (g) | 11.500 | 12.686 | 0,43 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | |
| 3,676 % fällig am 12.06.2024 | 4.400 | 4.415 | 0,15 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | |
| 2,750 % fällig am 26.03.2020 | 700 | 701 | 0,02 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | |
| 2,250 % fällig am 01.09.2021 | 600 | 597 | 0,02 |
| 3,400 % fällig am 15.02.2021 | 700 | 710 | 0,02 |
| 4,875 % fällig am 15.04.2022 | 400 | 425 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2023 | 600 | 653 | 0,02 |
| **Deutsche Bank AG** | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € 5.100 | 5.858 | 0,20 |
| 3,150 % fällig am 22.01.2021 | $ 1.600 | 1.588 | 0,05 |
| 3,407 % fällig am 22.01.2021 | 14.800 | 14.607 | 0,50 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | 10.100 | 10.243 | 0,35 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | |
| 1,875 % fällig am 15.09.2021 | 5.200 | 5.187 | 0,18 |
| **Discover Bank** | | | |
| 4,650 % fällig am 13.09.2028 | 3.300 | 3.612 | 0,12 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 0,050 % fällig am 01.12.2021 | € 100 | 111 | 0,00 |
| 2,425 % fällig am 12.06.2020 | $ 700 | 697 | 0,02 |
| 2,459 % fällig am 27.03.2020 | 200 | 199 | 0,01 |
| 2,597 % fällig am 04.11.2019 | 1.600 | 1.599 | 0,05 |
| 3,006 % fällig am 02.11.2020 | 300 | 297 | 0,01 |
| 3,273 % fällig am 24.09.2020 | 4.300 | 4.297 | 0,15 |
| 3,408 % fällig am 05.04.2021 | 800 | 790 | 0,03 |
| 3,484 % fällig am 12.10.2021 | 2.000 | 1.969 | 0,07 |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 | 600 | 611 | 0,02 |
| 8,125 % fällig am 15.01.2020 | 2.000 | 2.057 | 0,07 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | |
| 3,500 % fällig am 10.07.2019 | 800 | 800 | 0,03 |
| 3,588 % fällig am 05.01.2023 | 300 | 296 | 0,01 |
| 3,872 % fällig am 04.10.2019 | 3.000 | 3.007 | 0,10 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 3,612 % fällig am 23.10.2019 | 8.900 | 8.926 | 0,31 |
| 3,688 % fällig am 15.11.2021 | 1.500 | 1.513 | 0,05 |
| 3,752 % fällig am 23.04.2020 | 5.800 | 5.837 | 0,20 |
| 4,291 % fällig am 25.02.2021 | 5.700 | 5.830 | 0,20 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | |
| 2,550 % fällig am 09.06.2022 | 1.400 | 1.391 | 0,05 |
| 2,850 % fällig am 15.01.2021 | 900 | 902 | 0,03 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | |
| 3,250 % fällig am 30.05.2022 | 5.800 | 5.865 | 0,20 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | |
| 3,086 % fällig am 11.09.2021 | 3.800 | 3.804 | 0,13 |
| 3,120 % fällig am 18.05.2021 | 1.700 | 1.702 | 0,06 |
| 3,520 % fällig am 18.05.2024 | 1.200 | 1.204 | 0,04 |
| 4,693 % fällig am 08.03.2021 | 5.900 | 6.073 | 0,21 |
| **HSBC USA, Inc.** | | | |
| 2,350 % fällig am 05.03.2020 | 12.000 | 12.003 | 0,41 |
| **ING Bank NV** | | | |
| 2,450 % fällig am 16.03.2020 | 1.500 | 1.502 | 0,05 |
| 2,500 % fällig am 01.10.2019 | 400 | 400 | 0,01 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.04.2021 | 200 | 206 | 0,01 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | 7.800 | 8.418 | 0,29 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | |
| 3,012 % fällig am 18.06.2022 | 5.100 | 5.111 | 0,17 |
| 3,200 % fällig am 01.06.2021 | 4.300 | 4.316 | 0,15 |
| 3,480 % fällig am 25.04.2023 | 7.500 | 7.539 | 0,26 |
| 3,482 % fällig am 23.07.2024 | 10.800 | 10.839 | 0,37 |
| 3,547 % fällig am 23.01.2020 | 6.900 | 6.936 | 0,24 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | |
| 2,926 % fällig am 26.04.2021 | 900 | 901 | 0,03 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | £ 100 | 128 | 0,00 |
| 3,186 % fällig am 21.06.2021 | $ 2.000 | 2.001 | 0,07 |
| 4,050 % fällig am 16.08.2023 | 1.100 | 1.149 | 0,04 |
| 4,550 % fällig am 16.08.2028 | 1.100 | 1.186 | 0,04 |
| **Logicor Financing SARL** | | | |
| 0,500 % fällig am 30.04.2021 | € 1.100 | $ 1.264 | 0,04 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | 6.000 | 7.294 | 0,25 |
| **Macquarie Bank Ltd.** | | | |
| 3,702 % fällig am 29.07.2020 | $ 500 | 505 | 0,02 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | |
| 3,236 % fällig am 26.07.2021 | 1.000 | 1.004 | 0,03 |
| 3,443 % fällig am 22.02.2022 | 2.500 | 2.523 | 0,09 |
| 3,446 % fällig am 26.07.2023 | 8.000 | 8.018 | 0,27 |
| **Mitsubishi UFJ Trust & Banking Corp.** | | | |
| 2,450 % fällig am 16.10.2019 | 400 | 400 | 0,01 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | |
| 2,273 % fällig am 13.09.2021 | 600 | 598 | 0,02 |
| 2,601 % fällig am 11.09.2022 | 900 | 900 | 0,03 |
| 3,461 % fällig am 28.02.2022 | 2.600 | 2.623 | 0,09 |
| 4,084 % fällig am 12.04.2021 | 2.400 | 2.444 | 0,08 |
| **Morgan Stanley** | | | |
| 3,095 % fällig am 10.02.2021 | 2.300 | 2.303 | 0,08 |
| 3,737 % fällig am 24.04.2024 | 4.100 | 4.277 | 0,15 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | |
| 2,250 % fällig am 16.03.2021 | 4.100 | 4.111 | 0,14 |
| **Nationwide Building Society** | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | 8.700 | 8.885 | 0,30 |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | 2.400 | 2.507 | 0,09 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 5,000 % fällig am 26.10.2020 | 600 | 613 | 0,02 |
| 5,875 % fällig am 25.03.2021 | 300 | 313 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | 4.800 | 4.980 | 0,17 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | |
| 1,550 % fällig am 13.09.2019 | 1.000 | 998 | 0,03 |
| 1,900 % fällig am 14.09.2021 | 2.800 | 2.750 | 0,09 |
| 2,550 % fällig am 08.03.2021 | 4.300 | 4.288 | 0,15 |
| 2,650 % fällig am 13.07.2022 | 2.900 | 2.892 | 0,10 |
| 3,247 % fällig am 13.07.2022 | 5.100 | 5.076 | 0,17 |
| **Nordea Bank Abp** | | | |
| 4,875 % fällig am 27.01.2020 | 200 | 203 | 0,01 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | |
| 2,975 % fällig am 17.05.2021 | 3.600 | 3.603 | 0,12 |
| **Protective Life Global Funding** | | | |
| 1,999 % fällig am 14.09.2021 | 3.500 | 3.468 | 0,12 |
| 2,850 % fällig am 28.06.2021 | 7.600 | 7.629 | 0,26 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | |
| 3,872 % fällig am 31.05.2021 | 5.600 | 5.677 | 0,19 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | 7.700 | 7.719 | 0,26 |
| **Royal Bank of Canada** | | | |
| 2,300 % fällig am 22.03.2021 | 5.000 | 5.026 | 0,17 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | € 5.400 | 6.392 | 0,22 |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | $ 6.500 | 6.490 | 0,22 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | |
| 3,700 % fällig am 28.03.2022 | 900 | 922 | 0,03 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | |
| 2,875 % fällig am 16.10.2020 | 300 | 301 | 0,01 |
| 4,796 % fällig am 15.11.2024 | 3.400 | 3.615 | 0,12 |
| **Santander UK PLC** | | | |
| 2,875 % fällig am 18.06.2024 | 9.300 | 9.362 | 0,32 |
| **SL Green Operating Partnership LP** | | | |
| 3,505 % fällig am 16.08.2021 | 4.300 | 4.302 | 0,15 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | |
| 2,650 % fällig am 15.07.2021 | 800 | 800 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | 1.900 | 1.925 | 0,07 |
| 4,125 % fällig am 15.07.2023 | 2.500 | 2.618 | 0,09 |
| **Societe Generale S.A.** | | | |
| 3,919 % fällig am 08.04.2021 | 3.000 | 3.042 | 0,10 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | 400 | 430 | 0,01 |
| **Standard Chartered PLC** | | | |
| 3,650 % fällig am 19.08.2019 | 2.700 | 2.704 | 0,09 |
| **State Bank of India** | | | |
| 3,442 % fällig am 20.01.2020 | 7.800 | 7.813 | 0,27 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | |
| 3,341 % fällig am 18.10.2022 | 2.600 | 2.606 | 0,09 |
| 4,133 % fällig am 09.03.2021 | 7.100 | 7.249 | 0,25 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | |
| 2,250 % fällig am 25.09.2019 | 300 | 300 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 15.03.2021 | 5.300 | 5.317 | 0,18 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **UBS AG** | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (g) | $ | 500 | $ 561 | 0,02 |
| **UniCredit SpA** | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 3.150 | 3.601 | 0,12 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | |
| 0,625 % fällig am 08.09.2021 | € | 500 | 575 | 0,02 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | |
| 0,140 % fällig am 06.07.2021 | | 1.700 | 1.933 | 0,07 |
| | | | 454.189 | 15,51 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **AbbVie, Inc.** | | | | |
| 2,900 % fällig am 06.11.2022 | $ | 3.400 | 3.425 | 0,12 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | | 200 | 205 | 0,01 |
| **Anthem, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.08.2021 | | 200 | 205 | 0,01 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 2,764 % fällig am 15.08.2022 | | 3.100 | 3.106 | 0,11 |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | | 15.600 | 15.641 | 0,53 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.09.2019 | | 1.700 | 1.697 | 0,06 |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | | 2.600 | 2.607 | 0,09 |
| 3,250 % fällig am 07.06.2022 | | 1.000 | 1.015 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2022 | | 600 | 614 | 0,02 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.07.2021 | | 400 | 400 | 0,01 |
| 2,979 % fällig am 25.06.2021 | | 1.700 | 1.689 | 0,06 |
| 3,000 % fällig am 08.10.2021 | | 1.000 | 1.008 | 0,03 |
| 3,420 % fällig am 15.12.2023 | | 2.400 | 2.358 | 0,08 |
| 3,500 % fällig am 25.06.2021 | | 800 | 812 | 0,03 |
| **Broadcom Corp.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2020 | | 2.500 | 2.496 | 0,09 |
| **Canadian Natural Resources Ltd.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.11.2021 | | 600 | 613 | 0,02 |
| **Celgene Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.08.2022 | | 400 | 411 | 0,01 |
| 3,550 % fällig am 15.08.2022 | | 500 | 518 | 0,02 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | | 4.500 | 4.507 | 0,15 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 4,229 % fällig am 01.02.2024 | | 6.700 | 6.732 | 0,23 |
| 4,500 % fällig am 01.02.2024 | | 1.500 | 1.600 | 0,06 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | |
| 3,092 % fällig am 09.10.2020 | | 700 | 699 | 0,02 |
| 3,342 % fällig am 22.10.2020 | | 1.700 | 1.700 | 0,06 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.09.2022 | | 320 | 323 | 0,01 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.02.2020 | | 2.400 | 2.417 | 0,08 |
| 4,375 % fällig am 15.09.2022 | | 900 | 938 | 0,03 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 05.07.2019 | | 300 | 300 | 0,01 |
| 2,200 % fällig am 30.10.2021 | | 200 | 198 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 03.09.2019 | | 200 | 200 | 0,01 |
| 3,400 % fällig am 22.02.2022 | | 250 | 255 | 0,01 |
| 3,875 % fällig am 15.09.2021 | | 900 | 926 | 0,03 |
| **Danone S.A.** | | | | |
| 1,691 % fällig am 30.10.2019 | | 400 | 399 | 0,01 |
| 2,077 % fällig am 02.11.2021 | | 4.700 | 4.671 | 0,16 |
| 2,589 % fällig am 02.11.2023 | | 1.700 | 1.709 | 0,06 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 400 | 412 | 0,01 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 04.12.2020 | | 500 | 500 | 0,02 |
| 2,875 % fällig am 13.03.2020 | | 300 | 300 | 0,01 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 1,950 % fällig am 19.09.2021 | | 700 | 693 | 0,02 |
| 2,225 % fällig am 17.01.2020 | | 800 | 798 | 0,03 |
| 2,820 % fällig am 19.01.2022 | | 1.750 | 1.766 | 0,06 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 2,200 % fällig am 20.09.2019 | | 300 | 300 | 0,01 |
| 2,800 % fällig am 15.06.2020 | | 1.000 | 1.002 | 0,03 |
| 2,950 % fällig am 20.03.2023 | | 1.200 | 1.212 | 0,04 |
| 3,097 % fällig am 20.09.2019 | | 1.500 | 1.502 | 0,05 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | | 1.400 | 1.410 | 0,05 |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 2.500 | 2.516 | 0,09 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.11.2020 | $ | 100 | $ 100 | 0,00 |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | | 4.700 | 4.722 | 0,16 |
| **Dongfeng Motor Hong Kong International Co. Ltd.** | | | | |
| 1,150 % fällig am 23.10.2021 | € | 1.600 | 1.859 | 0,06 |
| **DXC Technology Co.** | | | | |
| 3,470 % fällig am 01.03.2021 | $ | 4.462 | 4.462 | 0,15 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.07.2022 | | 1.200 | 1.203 | 0,04 |
| 2,750 % fällig am 30.01.2023 | | 4.300 | 4.326 | 0,15 |
| 3,453 % fällig am 30.01.2023 | | 300 | 302 | 0,01 |
| 3,800 % fällig am 09.03.2022 | | 300 | 311 | 0,01 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 3.400 | 3.382 | 0,12 |
| **EMD Finance LLC** | | | | |
| 2,400 % fällig am 19.03.2020 | | 400 | 400 | 0,01 |
| **Enable Oklahoma Intrastate Transmission LLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.03.2020 | | 300 | 307 | 0,01 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 9.100 | 9.103 | 0,31 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | | 2.200 | 2.238 | 0,08 |
| 4,650 % fällig am 01.06.2021 | | 600 | 623 | 0,02 |
| 5,200 % fällig am 01.02.2022 | | 400 | 423 | 0,01 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | | 2.200 | 2.262 | 0,08 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 5,200 % fällig am 01.09.2020 | | 700 | 723 | 0,02 |
| **EQT Corp.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 01.10.2020 | | 1.900 | 1.895 | 0,07 |
| **Equifax, Inc.** | | | | |
| 3,388 % fällig am 15.08.2021 | | 2.300 | 2.295 | 0,08 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | |
| 2,350 % fällig am 15.10.2019 | | 6.100 | 6.093 | 0,21 |
| 2,600 % fällig am 01.12.2021 | | 300 | 301 | 0,01 |
| 3,300 % fällig am 15.10.2022 | | 500 | 514 | 0,02 |
| 4,500 % fällig am 16.08.2021 | | 300 | 313 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 01.10.2020 | | 400 | 414 | 0,01 |
| **Express Scripts Holding Co.** | | | | |
| 3,050 % fällig am 30.11.2022 | | 1.000 | 1.016 | 0,04 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.08.2021 | | 200 | 200 | 0,01 |
| **Florida Gas Transmission Co. LLC** | | | | |
| 5,450 % fällig am 15.07.2020 | | 700 | 718 | 0,02 |
| **Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.10.2020 | | 400 | 406 | 0,01 |
| 5,625 % fällig am 31.07.2019 | | 100 | 100 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 15.02.2021 | | 800 | 835 | 0,03 |
| **Fresenius U.S. Finance, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.02.2021 | | 200 | 205 | 0,01 |
| **GATX Corp.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 30.07.2019 | | 100 | 100 | 0,00 |
| **Harris Corp.** | | | | |
| 3,063 % fällig am 30.04.2020 | | 9.300 | 9.298 | 0,32 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2022 | | 900 | 984 | 0,03 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2023 | | 300 | 320 | 0,01 |
| **Holcim U.S. Finance SARL & Cie SCS** | | | | |
| 6,000 % fällig am 30.12.2019 | | 100 | 101 | 0,00 |
| **Humana, Inc.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.12.2020 | | 1.200 | 1.201 | 0,04 |
| 2,625 % fällig am 01.10.2019 | | 500 | 500 | 0,02 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 1,750 % fällig am 27.09.2019 | | 300 | 299 | 0,01 |
| 3,402 % fällig am 18.09.2020 | | 2.700 | 2.709 | 0,09 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,735 % PIK)** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b) | € | 3.500 | 4.084 | 0,14 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar und 7,125 % PIK)** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2029 (b) | $ | 1.200 | 1.203 | 0,04 |
| **IHS Markit Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.11.2022 | | 600 | 639 | 0,02 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.07.2020 | | 1.400 | 1.404 | 0,05 |
| 3,750 % fällig am 21.07.2022 | | 3.300 | 3.399 | 0,12 |
| **Incitec Pivot Finance LLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 10.12.2019 | | 200 | 203 | 0,01 |
| **Interpublic Group of Cos., Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.10.2020 | $ | 500 | $ 506 | 0,02 |
| 4,000 % fällig am 15.03.2022 | | 100 | 103 | 0,00 |
| **JB Hunt Transport Services, Inc.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.08.2022 | | 300 | 307 | 0,01 |
| **JT International Financial Services BV** | | | | |
| 1,125 % fällig am 28.09.2025 | € | 2.100 | 2.493 | 0,09 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | | |
| 6,850 % fällig am 15.02.2020 | $ | 600 | 615 | 0,02 |
| **KLA-Tencor Corp.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.11.2019 | | 3.000 | 3.006 | 0,10 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 3,115 % fällig am 10.02.2021 | | 17.250 | 17.223 | 0,59 |
| 3,365 % fällig am 10.08.2022 | | 2.200 | 2.191 | 0,08 |
| 3,500 % fällig am 06.06.2022 | | 2.000 | 2.054 | 0,07 |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 3.200 | 3.277 | 0,11 |
| **Kroger Co.** | | | | |
| 1,500 % fällig am 30.09.2019 | | 200 | 199 | 0,01 |
| **Marathon Oil Corp.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 01.06.2020 | | 800 | 801 | 0,03 |
| 2,800 % fällig am 01.11.2022 | | 1.300 | 1.306 | 0,04 |
| **Martin Marietta Materials, Inc.** | | | | |
| 2,887 % fällig am 20.12.2019 | | 400 | 400 | 0,01 |
| **Marvell Technology Group Ltd.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 22.06.2023 | | 11.025 | 11.489 | 0,39 |
| **Masco Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2021 | | 1.200 | 1.218 | 0,04 |
| **McCormick & Co., Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 15.08.2022 | | 1.400 | 1.413 | 0,05 |
| **McDonald's Corp.** | | | | |
| 3,012 % fällig am 28.10.2021 | | 2.300 | 2.302 | 0,08 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 5,250 % fällig am 31.03.2020 | | 200 | 204 | 0,01 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | | 400 | 419 | 0,01 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | | |
| 3,922 % fällig am 01.06.2021 | | 2.500 | 2.546 | 0,09 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | |
| 5,327 % fällig am 06.02.2029 | | 200 | 212 | 0,01 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.10.2021 | | 2.600 | 2.577 | 0,09 |
| **Mylan NV** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.06.2021 | | 600 | 600 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 15.12.2020 | | 500 | 505 | 0,02 |
| **NetApp, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.06.2021 | | 600 | 607 | 0,02 |
| **Newmont Goldcorp Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2019 | | 500 | 503 | 0,02 |
| **Norfolk Southern Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.04.2022 | | 400 | 407 | 0,01 |
| 3,250 % fällig am 01.12.2021 | | 100 | 102 | 0,00 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 21.07.2021 | | 1.400 | 1.388 | 0,05 |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | | 2.400 | 2.461 | 0,08 |
| **ONEOK Partners LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.10.2022 | | 1.400 | 1.423 | 0,05 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 23.09.2020 | | 600 | 612 | 0,02 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 1.400 | 1.482 | 0,05 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 2,700 % fällig am 14.03.2023 | | 700 | 700 | 0,02 |
| 3,200 % fällig am 15.07.2020 | | 1.200 | 1.206 | 0,04 |
| 3,375 % fällig am 01.02.2022 | | 1.300 | 1.326 | 0,05 |
| 3,900 % fällig am 01.02.2024 | | 300 | 314 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 11.07.2022 | | 1.500 | 1.595 | 0,05 |
| **Pernod Ricard S.A.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.07.2022 | | 1.000 | 1.049 | 0,04 |
| 4,450 % fällig am 15.01.2022 | | 4.900 | 5.129 | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 07.04.2021 | | 2.455 | 2.593 | 0,09 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.01.2020 | | 300 | 308 | 0,01 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | |
| 2,903 % fällig am 24.06.2022 | | 2.200 | 2.193 | 0,08 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.06.2020 | | 400 | 403 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 01.05.2020 | | 500 | 518 | 0,02 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Rockwell Collins, Inc.** | | | |
| 2,800 % fällig am 15.03.2022 | $ 200 | $ 202 | 0,01 |
| **Ryder System, Inc.** | | | |
| 2,450 % fällig am 03.09.2019 | 1.500 | 1.500 | 0,05 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | 3.800 | 3.948 | 0,14 |
| 5,625 % fällig am 01.03.2025 | 200 | 224 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 15.03.2022 | 4.900 | 5.320 | 0,18 |
| **Sands China Ltd.** | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | 3.600 | 3.791 | 0,13 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | 4.200 | 4.513 | 0,15 |
| **Shire Acquisitions Investments Ireland DAC** | | | |
| 1,900 % fällig am 23.09.2019 | 5.800 | 5.791 | 0,20 |
| **SK Telecom Co. Ltd.** | | | |
| 3,750 % fällig am 16.04.2023 | 600 | 624 | 0,02 |
| **Sky Ltd.** | | | |
| 2,625 % fällig am 16.09.2019 | 1.400 | 1.400 | 0,05 |
| 3,125 % fällig am 26.11.2022 | 500 | 513 | 0,02 |
| **Southern Co.** | | | |
| 2,350 % fällig am 01.07.2021 | 500 | 500 | 0,02 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | |
| 3,360 % fällig am 20.03.2023 | 1.519 | 1.523 | 0,05 |
| **Sunoco Logistics Partners Operations LP** | | | |
| 4,650 % fällig am 15.02.2022 | 300 | 315 | 0,01 |
| **Suntory Holdings Ltd.** | | | |
| 2,550 % fällig am 28.06.2022 | 6.700 | 6.701 | 0,23 |
| **Syngenta Finance NV** | | | |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | 1.000 | 1.007 | 0,03 |
| 3,933 % fällig am 23.04.2021 | 4.300 | 4.379 | 0,15 |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | 4.050 | 4.213 | 0,14 |
| **Tech Data Corp.** | | | |
| 3,700 % fällig am 15.02.2022 | 1.400 | 1.425 | 0,05 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | |
| 5,134 % fällig am 27.04.2020 | 1.500 | 1.531 | 0,05 |
| 5,462 % fällig am 16.02.2021 | 700 | 734 | 0,03 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | |
| 3,300 % fällig am 15.02.2022 | 400 | 410 | 0,01 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.09.2021 | 900 | 924 | 0,03 |
| 4,125 % fällig am 15.02.2021 | 300 | 306 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2020 | 2.700 | 2.736 | 0,09 |
| **Tyson Foods, Inc.** | | | |
| 2,250 % fällig am 23.08.2021 | 200 | 200 | 0,01 |
| 2,650 % fällig am 15.08.2019 | 1.000 | 1.000 | 0,03 |
| **United Technologies Corp.** | | | |
| 3,175 % fällig am 16.08.2021 | 1.000 | 1.001 | 0,03 |
| 3,650 % fällig am 16.08.2023 | 4.600 | 4.821 | 0,17 |
| 3,950 % fällig am 16.08.2025 | 300 | 324 | 0,01 |
| **VMware, Inc.** | | | |
| 2,300 % fällig am 21.08.2020 | 5.000 | 4.988 | 0,17 |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | 6.200 | 6.252 | 0,21 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | |
| 2,400 % fällig am 22.05.2020 | 200 | 200 | 0,01 |
| 2,450 % fällig am 20.11.2019 | 1.700 | 1.699 | 0,06 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | |
| 4,000 % fällig am 12.08.2020 | 200 | 203 | 0,01 |
| **Wabtec Corp.** | | | |
| 3,710 % fällig am 15.09.2021 | 4.700 | 4.688 | 0,16 |
| **Woolworths Group Ltd.** | | | |
| 4,550 % fällig am 12.04.2021 | 200 | 206 | 0,01 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | 900 | 905 | 0,03 |
| 4,500 % fällig am 29.04.2022 | 1.600 | 1.631 | 0,06 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | |
| 2,700 % fällig am 01.04.2020 | 3.288 | 3.292 | 0,11 |
| 3,150 % fällig am 01.04.2022 | 800 | 813 | 0,03 |
| 3,169 % fällig am 19.03.2021 | 700 | 699 | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 30.11.2021 | 1.200 | 1.221 | 0,04 |
| 4,625 % fällig am 30.11.2019 | 400 | 403 | 0,01 |
| | | 330.661 | 11,30 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | 17.300 | 17.391 | 0,59 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | 4.400 | 4.440 | 0,15 |
| 3,616 % fällig am 12.06.2024 | 6.200 | 6.282 | 0,22 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2022 | 400 | 415 | 0,01 |
| **Baltimore Gas & Electric Co.** | | | |
| 2,800 % fällig am 15.08.2022 | $ 200 | $ 203 | 0,01 |
| **BG Energy Capital PLC** | | | |
| 4,000 % fällig am 15.10.2021 | 400 | 414 | 0,01 |
| **BP Capital Markets PLC** | | | |
| 2,518 % fällig am 16.01.2020 | 200 | 201 | 0,01 |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** | | | |
| 2,701 % fällig am 16.03.2020 | 400 | 401 | 0,01 |
| **DTE Energy Co.** | | | |
| 2,400 % fällig am 01.12.2019 | 400 | 400 | 0,01 |
| **Duke Energy Corp.** | | | |
| 3,028 % fällig am 14.05.2021 | 4.500 | 4.512 | 0,15 |
| 3,050 % fällig am 15.08.2022 | 900 | 918 | 0,03 |
| 3,550 % fällig am 15.09.2021 | 500 | 511 | 0,02 |
| **Duquesne Light Holdings, Inc.** | | | |
| 6,400 % fällig am 15.09.2020 | 100 | 104 | 0,00 |
| **Emera U.S. Finance LP** | | | |
| 2,700 % fällig am 15.06.2021 | 900 | 903 | 0,03 |
| **Entergy Corp.** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.09.2020 | 100 | 102 | 0,00 |
| **Exelon Corp.** | | | |
| 2,850 % fällig am 15.06.2020 | 100 | 100 | 0,00 |
| **LG&E & KU Energy LLC** | | | |
| 4,375 % fällig am 01.10.2021 | 400 | 415 | 0,01 |
| **Mississippi Power Co.** | | | |
| 2,961 % fällig am 27.03.2020 | 1.500 | 1.500 | 0,05 |
| **Niagara Mohawk Power Corp.** | | | |
| 2,721 % fällig am 28.11.2022 | 200 | 203 | 0,01 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | |
| 2,600 % fällig am 15.12.2019 | 800 | 800 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2020 | 200 | 203 | 0,01 |
| **Progress Energy, Inc.** | | | |
| 4,875 % fällig am 01.12.2019 | 800 | 808 | 0,03 |
| **Public Service Enterprise Group, Inc.** | | | |
| 2,000 % fällig am 15.11.2021 | 200 | 198 | 0,01 |
| **Sempra Energy** | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | 2.000 | 1.992 | 0,07 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | |
| 4,125 % fällig am 12.09.2025 | 5.000 | 5.342 | 0,18 |
| **Southern Power Co.** | | | |
| 2,937 % fällig am 20.12.2020 | 800 | 800 | 0,03 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 7,000 % fällig am 01.03.2020 | 800 | 822 | 0,03 |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | 700 | 727 | 0,03 |
| **Sprint Corp.** | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | 200 | 213 | 0,01 |
| **State Grid Overseas Investment Ltd.** | | | |
| 3,750 % fällig am 02.05.2023 | 5.200 | 5.424 | 0,19 |
| **Telstra Corp. Ltd.** | | | |
| 4,800 % fällig am 12.10.2021 | 500 | 526 | 0,02 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 3,073 % fällig am 22.05.2020 | 2.000 | 2.008 | 0,07 |
| **Vodafone Group PLC** | | | |
| 3,591 % fällig am 16.01.2024 | 3.300 | 3.311 | 0,11 |
| | | 62.589 | 2,14 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | 847.439 | 28,95 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **California State General Obligation Bonds, Series 2017** | | | |
| 2,193 % fällig am 01.04.2047 | 1.400 | 1.400 | 0,05 |
| 3,211 % fällig am 01.04.2047 | 3.900 | 3.913 | 0,13 |
| | | 5.313 | 0,18 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 2,936 % fällig am 25.09.2046 | 2.974 | 2.976 | 0,10 |
| 2,954 % fällig am 25.09.2041 | 537 | 540 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 25.10.2040 | 1.752 | 1.793 | 0,06 |
| 3,074 % fällig am 25.03.2038 | 682 | 691 | 0,02 |
| 3,154 % fällig am 25.06.2040 | 106 | 107 | 0,00 |
| 3,372 % fällig am 25.11.2022 | 1.513 | 1.514 | 0,05 |
| 3,682 % fällig am 01.07.2044 | 5 | 5 | 0,00 |
| 3,976 % fällig am 25.03.2037 (a) | 570 | 88 | 0,00 |
| 4,034 % fällig am 01.10.2034 | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,263 % fällig am 01.11.2035 | 6 | 6 | 0,00 |
| 4,281 % fällig am 01.09.2035 | 28 | 29 | 0,00 |
| 4,327 % fällig am 01.07.2035 | $ 22 | $ 23 | 0,00 |
| 4,607 % fällig am 01.05.2038 | 495 | 520 | 0,02 |
| 4,675 % fällig am 01.01.2036 | 716 | 755 | 0,03 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.02.2045 - 01.05.2048 | 302.214 | 311.091 | 10,63 |
| 4,000 % fällig am 01.06.2047 - 01.06.2049 | 28.550 | 29.724 | 1,02 |
| 6,500 % fällig am 01.10.2036 | 71 | 82 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 40.964 | 41.884 | 1,43 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 281.500 | 290.874 | 9,94 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 2,794 % fällig am 15.06.2041 | 861 | 862 | 0,03 |
| 2,949 % fällig am 15.07.2040 | 1.322 | 1.318 | 0,05 |
| 2,986 % fällig am 15.03.2042 | 465 | 465 | 0,02 |
| 3,488 % fällig am 25.02.2045 | 34 | 34 | 0,00 |
| 4,521 % fällig am 01.09.2035 | 16 | 17 | 0,00 |
| 4,579 % fällig am 01.06.2035 | 25 | 27 | 0,00 |
| 4,642 % fällig am 01.09.2037 | 968 | 1.021 | 0,04 |
| 5,200 % fällig am 01.05.2031 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 2,967 % fällig am 20.03.2065 | 28 | 28 | 0,00 |
| 3,209 % fällig am 20.10.2065 | 243 | 243 | 0,01 |
| 3,217 % fällig am 20.12.2065 | 2.039 | 2.051 | 0,07 |
| 3,237 % fällig am 20.02.2066 - 20.04.2068 | 8.383 | 8.439 | 0,29 |
| 3,267 % fällig am 20.01.2066 | 387 | 390 | 0,01 |
| 3,467 % fällig am 20.01.2066 | 6.148 | 6.247 | 0,21 |
| 3,487 % fällig am 20.06.2067 | 1.253 | 1.277 | 0,04 |
| 3,617 % fällig am 20.03.2066 | 633 | 646 | 0,02 |
| 3,625 % fällig am 20.04.2026 - 20.04.2041 | 489 | 509 | 0,02 |
| 3,750 % fällig am 20.08.2024 - 20.07.2027 | 42 | 42 | 0,00 |
| 4,125 % fällig am 20.10.2029 | 19 | 20 | 0,00 |
| | | 706.341 | 24,13 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049 | 13.000 | 14.280 | 0,49 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2021 | 3.773 | 3.739 | 0,13 |
| 0,125 % fällig am 15.01.2022 | 8.015 | 7.967 | 0,27 |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 | 91.823 | 91.122 | 3,11 |
| 0,125 % fällig am 15.07.2022 | 11.777 | 11.745 | 0,40 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | 22.788 | 23.169 | 0,79 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | 14.194 | 14.540 | 0,50 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | 7.329 | 7.639 | 0,26 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 1,375 % fällig am 30.09.2023 | 85.100 | 83.827 | 2,86 |
| 1,625 % fällig am 15.02.2026 | 1.100 | 1.084 | 0,04 |
| 2,000 % fällig am 30.04.2024 | 1.800 | 1.820 | 0,06 |
| 2,625 % fällig am 31.12.2025 | 3.800 | 3.980 | 0,14 |
| 3,000 % fällig am 30.09.2025 | 9.600 | 10.258 | 0,35 |
| 3,000 % fällig am 31.10.2025 | 9.600 | 10.263 | 0,35 |
| | | 285.433 | 9,75 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | |
| 2,594 % fällig am 25.09.2046 ^ | 187 | 179 | 0,01 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 4,753 % fällig am 20.02.2036 | 32 | 32 | 0,00 |
| 4,793 % fällig am 25.05.2035 | 5 | 6 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 4,761 % fällig am 25.01.2034 | 13 | 13 | 0,00 |
| 5,021 % fällig am 25.01.2034 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 4,001 % fällig am 25.01.2036 ^ | 99 | 102 | 0,00 |
| 4,294 % fällig am 25.09.2035 ^ | 11 | 10 | 0,00 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.06.2047 | 688 | 664 | 0,02 |
| 2,584 % fällig am 25.10.2036 | 3.333 | 3.171 | 0,11 |
| **Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust** | | | |
| 3,801 % fällig am 26.12.2046 ^ | 915 | 794 | 0,03 |
| 4,284 % fällig am 26.01.2036 ^ | 4.102 | 3.644 | 0,13 |
| **BX Trust** | | | |
| 3,314 % fällig am 15.07.2034 | 1.768 | 1.769 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Canadian Mortgage Pools** | | | | |
| 2,278 % fällig am 01.07.2020 | CAD | 8.206 | $ 6.294 | 0,22 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | | |
| 3,674 % fällig am 15.07.2027 | $ | 600 | 600 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,552 % fällig am 25.08.2035 ^ | | 216 | 194 | 0,01 |
| 4,810 % fällig am 25.05.2035 | | 10 | 10 | 0,00 |
| 4,970 % fällig am 25.10.2035 ^ | | 113 | 116 | 0,00 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | | |
| 2,564 % fällig am 25.02.2047 | | 137 | 133 | 0,01 |
| 2,578 % fällig am 20.12.2046 ^ | | 104 | 94 | 0,00 |
| 3,504 % fällig am 25.12.2035 | | 1.474 | 1.355 | 0,05 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 3,133 % fällig am 25.03.2032 | | 3 | 3 | 0,00 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,910 % fällig am 16.06.2069 | £ | 2.000 | 2.552 | 0,09 |
| **FirstMac Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 3,212 % fällig am 08.03.2049 | $ | 1.254 | 1.252 | 0,04 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 2,944 % fällig am 25.11.2045 | | 103 | 91 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 25.01.2034 | | 2 | 2 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,830 % fällig am 19.05.2035 | | 44 | 43 | 0,00 |
| 4,526 % fällig am 19.08.2036 ^ | | 120 | 115 | 0,00 |
| **Impac CMB Trust** | | | | |
| 3,164 % fällig am 25.10.2033 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Luminent Mortgage Trust** | | | | |
| 2,604 % fällig am 25.10.2046 | | 318 | 313 | 0,01 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | | |
| 2,874 % fällig am 15.06.2030 | | 15 | 15 | 0,00 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | | |
| 2,614 % fällig am 25.02.2036 | | 15 | 15 | 0,00 |
| 2,654 % fällig am 25.11.2035 | | 8 | 7 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.04.2029 | | 372 | 371 | 0,01 |
| 3,220 % fällig am 25.12.2029 | | 297 | 287 | 0,01 |
| 4,044 % fällig am 25.12.2032 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 4,358 % fällig am 25.12.2034 | | 13 | 13 | 0,00 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.02.2034 | | 58 | 55 | 0,00 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | |
| 4,485 % fällig am 25.09.2035 ^ | | 677 | 564 | 0,02 |
| **Rochester Financing PLC** | | | | |
| 2,081 % fällig am 18.06.2045 | £ | 3.285 | 4.204 | 0,14 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 2,983 % fällig am 20.12.2034 | $ | 594 | 595 | 0,02 |
| **Southern Pacific Financing PLC** | | | | |
| 0,966 % fällig am 10.06.2043 | £ | 505 | 637 | 0,02 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,904 % fällig am 25.01.2035 ^ | $ | 33 | 32 | 0,00 |
| 4,566 % fällig am 25.02.2034 | | 32 | 32 | 0,00 |
| 4,614 % fällig am 25.08.2034 | | 40 | 41 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.09.2047 | | 1.422 | 1.374 | 0,05 |
| 2,640 % fällig am 19.07.2035 | | 34 | 34 | 0,00 |
| 2,684 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 21 | 20 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.12.2035 ^ | | 118 | 121 | 0,01 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,044 % fällig am 25.09.2043 | | 832 | 841 | 0,03 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 7.800 | 9.965 | 0,34 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,971 % fällig am 15.07.2051 | | 1.616 | 2.068 | 0,07 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,345 % fällig am 27.02.2034 | $ | 9 | 9 | 0,00 |
| 2,674 % fällig am 25.12.2045 | | 15 | 15 | 0,00 |
| 2,694 % fällig am 25.10.2045 | | 8 | 8 | 0,00 |
| 3,704 % fällig am 25.11.2042 | | 5 | 5 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.08.2042 | | 8 | 7 | 0,00 |
| 3,910 % fällig am 25.08.2046 ^ | | 52 | 51 | 0,00 |
| 4,814 % fällig am 25.03.2034 | | 13 | 14 | 0,00 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 3,941 % fällig am 25.02.2033 | | 1 | 1 | 0,00 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 4,991 % fällig am 25.03.2036 | | 20 | 21 | 0,00 |
| 5,008 % fällig am 25.07.2036 ^ | $ | 381 | $ 389 | 0,01 |
| 5,165 % fällig am 25.04.2035 | | 979 | 1.013 | 0,04 |
| | | | 46.378 | 1,58 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,834 % fällig am 25.12.2035 | | 4.500 | 4.518 | 0,15 |
| **Black Diamond CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,650 % fällig am 03.10.2029 | € | 1.400 | 1.596 | 0,05 |
| 3,646 % fällig am 03.10.2029 | $ | 1.200 | 1.203 | 0,04 |
| **Black Diamond CLO Ltd.** | | | | |
| 3,638 % fällig am 06.02.2026 | | 3.049 | 3.050 | 0,10 |
| **CARDS Trust** | | | | |
| 2,744 % fällig am 17.04.2023 | | 2.100 | 2.102 | 0,07 |
| 3,047 % fällig am 17.04.2023 | | 2.100 | 2.112 | 0,07 |
| **Catamaran CLO Ltd.** | | | | |
| 3,432 % fällig am 27.01.2028 | | 2.900 | 2.888 | 0,10 |
| **Chase Funding Trust** | | | | |
| 3,144 % fällig am 25.10.2032 | | 3 | 3 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 4,054 % fällig am 25.07.2037 | | 1.963 | 2.019 | 0,07 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.08.2034 | | 230 | 229 | 0,01 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | | |
| 3,024 % fällig am 25.01.2032 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **Crown Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,762 % fällig am 20.10.2028 | | 3.300 | 3.293 | 0,11 |
| **Denali Capital CLO LLC** | | | | |
| 3,636 % fällig am 26.10.2027 | | 3.460 | 3.456 | 0,12 |
| **Dryden Senior Loan Fund** | | | | |
| 3,497 % fällig am 15.10.2027 | | 3.000 | 2.996 | 0,10 |
| **Flatiron CLO Ltd.** | | | | |
| 3,748 % fällig am 17.01.2026 | | 2.534 | 2.535 | 0,09 |
| **ICG U.S. CLO Ltd.** | | | | |
| 3,451 % fällig am 16.01.2028 | | 4.800 | 4.779 | 0,16 |
| **Jamestown CLO Ltd.** | | | | |
| 3,287 % fällig am 15.07.2026 | | 1.988 | 1.984 | 0,07 |
| 3,410 % fällig am 25.07.2027 | | 1.600 | 1.597 | 0,06 |
| **JMP Credit Advisors CLO Ltd.** | | | | |
| 3,438 % fällig am 17.01.2028 | | 5.200 | 5.176 | 0,18 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 2,664 % fällig am 25.06.2037 | | 1.700 | 1.679 | 0,06 |
| **Jubilee CLO BV** | | | | |
| 0,482 % fällig am 15.12.2029 | € | 1.900 | 2.158 | 0,07 |
| **LCM LP** | | | | |
| 3,632 % fällig am 20.10.2027 | $ | 3.000 | 3.000 | 0,10 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,964 % fällig am 25.10.2034 | | 5 | 5 | 0,00 |
| **Marathon CLO Ltd.** | | | | |
| 3,392 % fällig am 21.11.2027 | | 2.500 | 2.490 | 0,09 |
| **MidOcean Credit CLO** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.04.2027 | | 2.100 | 2.094 | 0,07 |
| **Navient Student Loan Trust** | | | | |
| 2,704 % fällig am 26.07.2066 | | 498 | 498 | 0,02 |
| 3,454 % fällig am 27.12.2066 | | 4.570 | 4.599 | 0,16 |
| 3,554 % fällig am 25.03.2066 | | 1.544 | 1.552 | 0,05 |
| **Oaktree CLO Ltd.** | | | | |
| 3,812 % fällig am 20.10.2026 | | 2.227 | 2.229 | 0,08 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | | 1.100 | 1.098 | 0,04 |
| 3,406 % fällig am 26.10.2027 | | 4.500 | 4.492 | 0,15 |
| **Octagon Investment Partners Ltd.** | | | | |
| 3,447 % fällig am 15.07.2027 | | 3.700 | 3.692 | 0,13 |
| 3,697 % fällig am 15.04.2026 | | 1.076 | 1.077 | 0,04 |
| **OZLM Ltd.** | | | | |
| 3,633 % fällig am 30.04.2027 | | 3.600 | 3.598 | 0,12 |
| 3,663 % fällig am 30.07.2027 | | 10.500 | 10.495 | 0,36 |
| **Palmer Square Loan Funding Ltd.** | | | | |
| 3,247 % fällig am 15.07.2026 | | 10.045 | 9.987 | 0,34 |
| 3,418 % fällig am 15.11.2026 | | 5.050 | 5.046 | 0,17 |
| **Panhandle-Plains Higher Education Authority, Inc.** | | | | |
| 3,722 % fällig am 01.10.2035 | | 122 | 122 | 0,00 |
| **Silver Arrow Canada LP** | | | | |
| 2,278 % fällig am 15.02.2020 | CAD | 1.128 | 864 | 0,03 |
| **SLM Private Education Loan Trust** | | | | |
| 4,644 % fällig am 16.06.2042 | $ | 3.300 | 3.338 | 0,11 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2023 | € | 51 | $ 58 | 0,00 |
| 0,000 % fällig am 17.06.2024 | | 203 | 231 | 0,01 |
| **SoFi Consumer Loan Program LLC** | | | | |
| 2,140 % fällig am 25.09.2026 | $ | 168 | 168 | 0,01 |
| **Sound Point CLO Ltd.** | | | | |
| 3,482 % fällig am 20.01.2028 | | 2.200 | 2.197 | 0,08 |
| **South Carolina Student Loan Corp.** | | | | |
| 3,520 % fällig am 03.09.2024 | | 119 | 120 | 0,00 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 3,379 % fällig am 25.12.2035 | | 396 | 397 | 0,01 |
| **THL Credit Wind River CLO Ltd.** | | | | |
| 3,467 % fällig am 15.10.2027 | | 2.000 | 1.997 | 0,07 |
| **TICP CLO Ltd.** | | | | |
| 3,601 % fällig am 20.04.2028 | | 8.900 | 8.826 | 0,30 |
| **Tralee CLO Ltd.** | | | | |
| 3,702 % fällig am 20.10.2028 | | 8.500 | 8.478 | 0,29 |
| **Utah State Board of Regents** | | | | |
| 3,154 % fällig am 25.01.2057 | | 2.233 | 2.234 | 0,08 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 3,667 % fällig am 15.04.2027 | | 9.700 | 9.677 | 0,33 |
| 3,742 % fällig am 22.10.2031 | | 6.800 | 6.798 | 0,23 |
| **WhiteHorse Ltd.** | | | | |
| 3,518 % fällig am 17.04.2027 | | 4.000 | 3.994 | 0,14 |
| **Z Capital Credit Partners CLO Ltd.** | | | | |
| 3,551 % fällig am 16.07.2027 | | 3.000 | 2.995 | 0,10 |
| **Zais CLO Ltd.** | | | | |
| 3,747 % fällig am 15.04.2028 | | 6.100 | 6.113 | 0,21 |
| | | | 163.937 | 5,60 |

## STAATSEMISSIONEN

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Development Bank of Japan, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 19.10.2021 | | 5.000 | 4.993 | 0,17 |
| 2,826 % fällig am 28.01.2020 | | 10.000 | 10.014 | 0,34 |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | | 3.800 | 3.833 | 0,13 |
| **Export-Import Bank of Korea** | | | | |
| 1,927 % fällig am 24.02.2020 (i) | CAD | 1.400 | 1.067 | 0,04 |
| **Japan Finance Organization for Municipalities** | | | | |
| 2,000 % fällig am 08.09.2020 | $ | 6.800 | 6.785 | 0,23 |
| 2,125 % fällig am 13.04.2021 | | 2.200 | 2.199 | 0,07 |
| **Japan Government International Bond** | | | | |
| 0,100 % fällig am 10.03.2028 (e) | ¥ | 3.282.273 | 31.820 | 1,09 |
| **Oman Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 08.03.2022 | $ | 2.000 | 1.971 | 0,07 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | PEN | 500 | 155 | 0,01 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 5.600 | 5.880 | 0,20 |
| 4,500 % fällig am 20.01.2022 | | 1.600 | 1.683 | 0,06 |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 2,375 % fällig am 26.10.2021 | | 2.900 | 2.899 | 0,10 |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 3.800 | 3.850 | 0,13 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | |
| 2,500 % fällig am 08.06.2022 | | 3.200 | 3.234 | 0,11 |
| | | | 80.383 | 2,75 |

## KURZFRISTIGE INSTRUMENTE

### COMMERCIAL PAPER

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Bank of Montreal** | | | | |
| 1,787 % fällig am 22.07.2019 | CAD | 4.400 | 3.363 | 0,11 |
| 1,802 % fällig am 12.07.2019 | | 4.300 | 3.288 | 0,11 |
| 1,806 % fällig am 31.07.2019 | | 11.100 | 8.481 | 0,29 |
| **Bank of Nova Scotia** | | | | |
| 1,773 % fällig am 22.07.2019 | | 7.100 | 5.427 | 0,19 |
| 1,785 % fällig am 22.07.2019 | | 6.000 | 4.586 | 0,16 |
| **Boston Scientific Corp.** | | | | |
| 2,910 % fällig am 09.07.2019 | $ | 3.800 | 3.797 | 0,13 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 2,830 % fällig am 18.07.2019 | | 2.600 | 2.596 | 0,09 |
| 2,870 % fällig am 16.07.2019 | | 3.300 | 3.296 | 0,11 |
| 2,910 % fällig am 09.07.2019 | | 5.200 | 5.196 | 0,18 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,100 % fällig am 15.08.2019 | | 3.300 | 3.289 | 0,11 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Crown Castle International Corp.** | | | |
| 2,800 % fällig am 17.07.2019 | $ 2.500 | $ 2.496 | 0,09 |
| **Enable Midstream Partners LP** | | | |
| 3,150 % fällig am 25.07.2019 | 2.500 | 2.495 | 0,09 |
| **Encana Corp.** | | | |
| 3,120 % fällig am 08.07.2019 | 2.300 | 2.298 | 0,08 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | |
| 3,030 % fällig am 02.07.2019 | 6.200 | 6.198 | 0,21 |
| **HSBC Bank Canada** | | | |
| 1,827 % fällig am 24.07.2019 CAD | 5.900 | 4.510 | 0,15 |
| 1,854 % fällig am 11.07.2019 | 7.600 | 5.813 | 0,20 |
| **Royal Bank of Canada** | | | |
| 1,765 % fällig am 02.07.2019 | 9.100 | 6.963 | 0,24 |
| 1,777 % fällig am 26.07.2019 | 8.100 | 6.190 | 0,21 |
| 1,795 % fällig am 31.07.2019 | 9.300 | 7.106 | 0,24 |
| 1,801 % fällig am 11.07.2019 | 2.700 | 2.065 | 0,07 |
| **Royal Caribbean Cruise** | | | |
| 2,850 % fällig am 30.07.2019 | $ 2.100 | 2.095 | 0,07 |
| 2,900 % fällig am 11.07.2019 | 1.200 | 1.199 | 0,04 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | |
| 1,765 % fällig am 02.07.2019 CAD | 9.700 | 7.422 | 0,25 |
| 1,787 % fällig am 22.07.2019 | 6.100 | 4.663 | 0,16 |
| **Virginia Electric & Power Co.** | | | |
| 2,590 % fällig am 05.08.2019 | $ 9.250 | $ 9.224 | 0,31 |
| **VW Credit, Inc.** | | | |
| 2,900 % fällig am 09.07.2019 | 4.000 | 3.997 | 0,14 |
| | | 118.053 | 4,03 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (k)** | | | |
| | | 458.094 | 15,65 |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 2,242 % fällig am 09.08.2019 (c)(d) | 20.000 | 19.952 | 0,68 |
| 2,243 % fällig am 16.08.2019 (c)(d) | 5.805 | 5.789 | 0,20 |
| 2,243 % fällig am 20.08.2019 (c)(d) | 5.700 | 5.683 | 0,19 |
| 2,249 % fällig am 19.07.2019 (c)(d) | 5.500 | 5.494 | 0,19 |
| 2,252 % fällig am 31.07.2019(c)(d) | 8.300 | 8.285 | 0,28 |
| 2,254 % fällig am 21.08.2019 (c)(d) | 4.000 | 3.987 | 0,14 |
| 2,285 % fällig am 10.07.2019 (c)(d) | 20.900 | 20.889 | 0,71 |
| 2,294 % fällig am 07.08.2019 (c)(d) | 57.400 | 57.270 | 1,96 |
| 2,299 % fällig am 07.08.2019 (c)(d) | 126.000 | 125.715 | 4,30 |
| 2,314 % fällig am 11.09.2019 (c)(d) | 96.700 | 96.284 | 3,29 |
| 2,336 % fällig am 03.07.2019 (c)(d) | 17.400 | 17.398 | 0,60 |
| 2,341 % fällig am 02.08.2019 (c)(d) | 1.000 | 998 | 0,03 |
| 2,359 % fällig am 31.07.2019 (c)(d) | $ 12.800 | $ 12.777 | 0,44 |
| 2,414 % fällig am 12.07.2019 (c)(d) | 6.200 | 6.196 | 0,21 |
| 2,434 % fällig am 05.07.2019 (c)(d) | 23.700 | 23.694 | 0,81 |
| 2,437 % fällig am 02.08.2019 (c)(d) | 5.900 | 5.888 | 0,20 |
| 2,438 % fällig am 10.07.2019 (c)(d) | 58.700 | 58.668 | 2,00 |
| 2,443 % fällig am 09.07.2019 (c)(d) | 16.800 | 16.792 | 0,57 |
| 2,448 % fällig am 02.08.2019 (c)(d) | 700 | 699 | 0,02 |
| 2,461 % fällig am 03.07.2019 (c)(d) | 15.700 | 15.698 | 0,54 |
| | | 508.156 | 17,36 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 1.084.303 | 37,04 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 3.219.604** | **109,98** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Long | 09/2019 | 6.865 | $ 16.039 | 0,55 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 39 | (78) | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1.138 | 1.417 | 0,05 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1.121 | 2.766 | 0,09 |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Short | 09/2019 | 117 | (645) | (0,02) |
| | | | | $ 19.499 | 0,67 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 19.499** | **0,67** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.12.2021 | $ 1.900 | $ 3 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.06.2022 | 700 | 3 | 0,00 |
| Enbridge, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 400 | 6 | 0,00 |
| Kinder Morgan, Inc. | 1,000 | 20.06.2021 | 900 | 12 | 0,00 |
| Kinder Morgan, Inc. | 1,000 | 20.12.2021 | 100 | 2 | 0,00 |
| | | | | $ 26 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-31 5-Year Index | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 118.800 | $ (1.898) | (0,07) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 % | 16.12.2020 | $ 3.500 | $ 8 | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,215 | 05.02.2026 | 4.500 | (226) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 3-Month USD-LIBOR | 2,240 | 23.06.2022 | 851.700 | (5.157) | (0,18) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 10.200 | (1.766) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,540 | 23.03.2048 | 1.800 | (132) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2021 | 947.000 | (16.374) | (0,56) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 8.500 | (611) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2049 | 12.300 | (1.768) | (0,06) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 3,010 % | 28.09.2023 | $ 35.900 | $ 2.140 | 0,07 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,080 | 28.09.2048 | 19.900 | (3.873) | (0,13) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,000 | 17.06.2025 | ¥ 570.000 | 1 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 17.06.2039 | 90.000 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,380 | 18.06.2028 | 3.070.000 | 43 | 0,00 |
| Erhalt | CPURNSA | 1,667 | 19.06.2024 | $ 23.200 | 138 | 0,01 |
| | | | | | $ (27.578) | (0,94) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (29.450)** | **(1,01)** |

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,370 % | 27.03.2020 | 43.100 | $ 1.733 | $ 40 | 0,00 |

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | UniCredit SpA | (1,000) % | 20.12.2023 | € 1.290 | $ 238 | $ (135) | $ 103 | 0,01 |
| CBK | UniCredit SpA | (1,000) | 20.12.2023 | 50 | 9 | (5) | 4 | 0,00 |
| HUS | UniCredit SpA | (1,000) | 20.12.2023 | 800 | 153 | (89) | 64 | 0,00 |
| | | | | | $ 400 | $ (229) | $ 171 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[2]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | AXA Equitable Holdings, Inc. | 1,000 % | 20.06.2023 | $ 3.000 | $ (82) | $ 63 | $ (19) | 0,00 |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.09.2019 | 2.900 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| NGF | Saudi Arabia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 16.700 | 111 | 112 | 223 | 0,01 |
| | | | | | $ 34 | $ 175 | $ 209 | 0,01 |

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

(2) Agiert der Teilfonds als 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.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des StocksPLUS™ Fund (Forts.)

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 44.535 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 245.801 | 08.08.2019 | $ 0 | $ 16.833 | $ 16.833 | 0,57 |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 4.409 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 25.623 | 16.10.2019 | 0 | 278 | 278 | 0,01 |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 28.127 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 160.647 | 06.11.2019 | 0 | 4.987 | 4.987 | 0,17 |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 12.596 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 71.350 | 11.06.2020 | 0 | 2.595 | 2.595 | 0,09 |
| BPS | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 65.461 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 361.297 | 04.12.2019 | 0 | 24.761 | 24.761 | 0,84 |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 11.794 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 68.422 | 09.01.2020 | 0 | 1.205 | 1.205 | 0,04 |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 7.201 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 42.169 | 14.10.2020 | 0 | 163 | 163 | 0,01 |
| BRC | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 23.005 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 132.600 | 26.05.2020 | 0 | 2.905 | 2.905 | 0,10 |
| CBK | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 35.288 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 204.720 | 18.03.2020 | 0 | 3.600 | 3.600 | 0,12 |
| FAR | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 14.589 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 80.521 | 20.11.2019 | 0 | 5.515 | 5.515 | 0,19 |
| GST | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 8.791 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 51.813 | 15.07.2019 | 0 | (107) | (107) | 0,00 |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 16.296 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 94.704 | 16.10.2019 | 0 | 1.029 | 1.029 | 0,03 |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 28.364 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 167.172 | 15.01.2020 | 0 | (350) | (350) | (0,01) |
| | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 24.264 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 137.443 | 12.03.2020 | 0 | 4.943 | 4.943 | 0,17 |
| | | | | | | | $ 0 | $ 68.357 | $ 68.357 | 2,33 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 6.586 | CAD | 8.662 | $ 43 | $ 0 | $ 43 | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 8.662 | $ | 6.590 | 0 | (43) | (43) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 22.510 | CHF | 22.485 | 645 | 0 | 645 | 0,02 |
| BPS | 07/2019 | CAD | 18.800 | $ | 14.267 | 0 | (120) | (120) | 0,00 |
| | 07/2019 | NZD | 212 | | 139 | 0 | (3 | (3) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.061 | CAD | 2.754 | 47 | 0 | 47 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 20.474 | £ | 16.142 | 70 | 0 | 70 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 355 | TRY | 2.101 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | ARS | 879 | $ | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 16.142 | | 20.505 | 0 | (71) | (71) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € | 40.718 | | 45.538 | 0 | (831) | (831) | (0,03) |
| CBK | 07/2019 | $ | 50.188 | € | 44.161 | 102 | 0 | 102 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.357 | £ | 1.072 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 44.161 | $ | 50.317 | 0 | (102) | (102) | 0,00 |
| | 09/2019 | PEN | 488 | | 146 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 11 | | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 21.434 | £ | 16.889 | 61 | 0 | 61 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 11.416 | $ | 8.469 | 0 | (267) | (267) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 1.167 | € | 1.025 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 20.257 | ¥ | 2.179.914 | 0 | (24) | (24) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 2.179.914 | $ | 20.304 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | CAD | 17.600 | | 13.354 | 0 | (121) | (121) | 0,00 |
| | 07/2019 | DKK | 3.965 | | 601 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 3.432 | | 3.880 | 0 | (28) | (28) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 3.485.600 | | 31.980 | 0 | (372) | (372) | (0,01) |
| | 09/2019 | INR | 10.370 | | 147 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CAD | 34.400 | | 26.267 | 0 | (74) | (74) | 0,00 |
| | 08/2019 | CHF | 22.543 | | 22.605 | 0 | (610) | (610) | (0,02) |
| RYL | 07/2019 | CAD | 6.000 | | 4.555 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 14.600 | | 10.952 | 0 | (223) | (223) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 34.103 | | 43.164 | 0 | (239) | (239) | (0,01) |
| SSB | 07/2019 | ¥ | 112.300 | | 1.040 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | $ | 13.174 | ¥ | 1.417.986 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 1.417.986 | $ | 13.205 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | | | | | | $ 1.018 | $ (3.189) | $ (2.171) | (0,07) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | € 87.302 | $ 99.209 | $ 0 | $ (209) | $ (209) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ 99.462 | € 87.302 | 211 | 0 | 211 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | € 80.718 | $ 91.773 | 0 | (148) | (148) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 246 | € 217 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | 91.763 | 80.501 | 146 | 0 | 146 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | 90.511 | 80.930 | 1.652 | 0 | 1.652 | 0,05 |
| CBK | 07/2019 | € 88.447 | $ 100.519 | 0 | (204) | (204) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 6.615 | € 5.801 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 08/2019 | 99.471 | 87.302 | 202 | 0 | 202 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | 33.261 | 29.694 | 555 | 0 | 555 | 0,02 |
| MYI | 07/2019 | 77.787 | 69.564 | 1.433 | 0 | 1.433 | 0,05 |
| RYL | 07/2019 | 4.144 | 3.663 | 27 | 0 | 27 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € 13.089 | $ 14.700 | 0 | (205) | (205) | (0,01) |
| SSB | 07/2019 | 2.243 | 2.506 | 0 | (48) | (48) | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | $ 90.496 | € 80.930 | 1.666 | 0 | 1.666 | 0,06 |
| | | | | $ 5.893 | $ (823) | $ 5.070 | 0,17 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 71.676** | **2,45** |

## LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.07.2049 (h) | $ 40.964 | $ (41.884) | (1,43) |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 103.200 | (105.496) | (3,61) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (147.380)** | **(5,04)** |
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 2,980 % fällig am 25.10.2019 | 11.300 | 11.312 | 0,39 |
| **Lloyds Bank Corporate Markets PLC** | | | |
| 2,843 % fällig am 24.09.2020 | 8.800 | 8.826 | 0,30 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 20.138** | **0,69** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 3.154.087** | **107,74** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (226.683)** | **(7,74)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 2.927.404** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(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) Bedingt wandelbares Wertpapier.

(h) Zum 30. Juni 2019 leerverkaufte Wertpapiere sind durch langfristige Portfolioanlagen in übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten abgedeckt.

(i) Eingeschränkte Wertpapiere:

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Export-Import Bank of Korea | 1,927 % | 24.02.2020 | 16.02.2017 | $ 1.072 | $ 1.067 | 0,04 |

(j) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 3.063 als Sicherheiten verpfändet.

Barmittel in Höhe von USD 60.233 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 950 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

**(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,800 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 143.900 | U.S. Treasury Notes 3,750 % fällig am 15.11.2043 | $ (147.798) | $ 143.900 | $ 143.934 | 4,92 |
| BPG | 2,550 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 65.100 | Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.12.2045 | (67.158) | 65.100 | 65.114 | 2,22 |
| FICC | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 15.894 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | (16.217) | 15.894 | 15.897 | 0,54 |
| RVM | 2,800 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 25.000 | U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.11.2028 | (25.536) | 25.000 | 25.006 | 0,86 |
| SAL | 2,800 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 208.200 | U.S. Treasury Notes 2,000 % - 2,750 % fällig am 30.11.2022 - 31.08.2023 | (212.629) | 208.200 | 208.249 | 7,11 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (469.338)** | **$ 458.094** | **$ 458.200** | **15,65** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 3.219.604 | $ 0 | $ 3.219.604 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 20.138 | 0 | 20.138 |
| Finanzderivate[3] | 19.499 | 42.226 | 0 | 61.725 |
| Leerverkäufe | 0 | (147.380) | 0 | (147.380) |
| **Summen** | **$ 19.499** | **$ 3.134.588** | **$ 0** | **$ 3.154.087** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 0 | $ 2.327.466 | $ 0 | $ 2.327.466 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 20.109 | 0 | 20.109 |
| Finanzderivate[3] | (22.967) | (142.264) | 0 | (165.231) |
| Leerverkäufe | 0 | (104.254) | 0 | (104.254) |
| **Summen** | **$ (22.967)** | **$ 2.101.057** | **$ 0** | **$ 2.078.090** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| JML | 1,000 % | 16.04.2019 | TBD[1] | $ (3.039) | $ (3.046) | (0,10) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (3.046)** | **(0,10)** |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 25.340 | $ (22.250) | $ 3.090 |
| BPS | 26.161 | (23.430) | 2.731 |
| BRC | 3.726 | (2.640) | 1.086 |
| CBK | 3.579 | (2.440) | 1.139 |
| FAR | 5.515 | (4.820) | 695 |
| GLM | 616 | (600) | 16 |
| GST | 5.515 | (2.870) | 2.645 |
| HUS | (198) | 0 | (198) |
| JPM | (527) | 610 | 83 |
| MYC | 40 | (610) | (570) |
| MYI | 749 | (800) | (51) |
| NGF | 223 | (280) | (57) |
| RYL | (11) | (60) | (71) |
| SCX | (667) | 340 | (327) |
| SSB | (50) | 0 | (50) |
| TOR | 1.666 | (1.700) | (34) |
| UAG | (1) | 0 | (1) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 41,90 | 44,86 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 48,96 | 48,55 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 19,12 | 7,82 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,67 | (1,00) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,01) | (0,50) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 2,45 | (5,69) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (5,04) | (4,53) |
| Einlagenzertifikate | 0,69 | 0,87 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (0,10) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 28,95 | 39,18 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,18 | 0,23 |
| US-Regierungsbehörden | 24,13 | 18,26 |
| US-Schatzobligationen | 9,75 | 9,44 |
| Non-Agency-MBS | 1,58 | 1,70 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 5,60 | 8,00 |
| Staatsemissionen | 2,75 | 2,64 |
| Kurzfristige Instrumente | 37,04 | 21,78 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,67 | (1,00) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,07) | 0,00 |
| Zinsswaps | (0,94) | (0,49) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Zinsswapoption | 0,00 | 0,34 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Zinsswapoption | 0,00 | (0,37) |
| 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 | 0,00 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 2,33 | (5,45) |
| Devisenterminkontrakte | (0,07) | (0,26) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,17 | 0,03 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (5,04) | (4,53) |
| Einlagenzertifikate | 0,69 | 0,87 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (7,74) | 9,62 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | $ 12 | $ 12 | 0,23 |
| **China Construction Bank Asia Corp. Ltd.** | | | |
| 3,250 % fällig am 02.07.2019 | 200 | 200 | 3,80 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | |
| 3,250 % fällig am 30.05.2022 | 200 | 202 | 3,83 |
| **Huarong Finance Co. Ltd.** | | | |
| 4,000 % fällig am 17.07.2019 | 200 | 200 | 3,80 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | 50 | 52 | 0,99 |
| | | 666 | 12,65 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| **Allied Universal Holdco LLC** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.07.2026 (a) | 100 | 102 | 1,93 |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | | |
| 3,750 % fällig am 22.09.2024 | 25 | 25 | 0,47 |
| **DISH DBS Corp.** | | | |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | 100 | 101 | 1,92 |
| **Fairstone Financial, Inc.** | | | |
| 7,875 % fällig am 15.07.2024 (a) | 12 | 12 | 0,23 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | 50 | 53 | 1,00 |
| **Staples, Inc.** | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2026 | 100 | 100 | 1,90 |
| | | 393 | 7,45 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| **Sprint Corp.** | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | 150 | 160 | 3,03 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | 1.219 | 23,13 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 400 | 409 | 7,77 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 3,488 % fällig am 25.02.2045 | 95 | 95 | 1,80 |
| | | 504 | 9,57 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)** | | | |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | 304 | 320 | 6,07 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Banc of America Alternative Loan Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.10.2020 | $ 53 | $ 52 | 0,99 |
| 6,000 % fällig am 25.03.2021 ^ | 40 | 36 | 0,68 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 4,794 % fällig am 25.06.2034 | 11 | 10 | 0,19 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 4,845 % fällig am 25.05.2037 | 29 | 28 | 0,53 |
| **CD Mortgage Trust** | | | |
| 6,431 % fällig am 15.11.2044 | 46 | 46 | 0,87 |
| **Chase Mortgage Finance Trust** | | | |
| 3,799 % fällig am 25.07.2037 | 4 | 3 | 0,06 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 3,504 % fällig am 25.12.2035 | 52 | 51 | 0,97 |
| 5,500 % fällig am 25.11.2035 | 29 | 26 | 0,49 |
| 5,915 % fällig am 25.11.2035 | 57 | 44 | 0,84 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,440 % fällig am 25.11.2035 | 52 | 53 | 1,01 |
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | |
| 2,880 % fällig am 25.02.2042 | 215 | 200 | 3,80 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 2,640 % fällig am 19.07.2035 | 51 | 51 | 0,97 |
| 3,024 % fällig am 25.09.2045 | 27 | 27 | 0,51 |
| **Structured Asset Securities Corp.** | | | |
| 2,684 % fällig am 25.01.2036 | 16 | 15 | 0,28 |
| **Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 6,308 % fällig am 15.05.2046 | 50 | 51 | 0,97 |
| | | 693 | 13,16 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **GSAA Home Equity Trust** | | | |
| 4,279 % fällig am 25.02.2035 | 100 | 100 | 1,90 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Peru Government International Bond** | | | |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 PEN | 100 | 31 | 0,59 |
| **AKTIEN** | | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (e)** | 3.800 | 386 | 7,32 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| **Ameren Corp.** | | | |
| 2,620 % fällig am 08.07.2019 | $ 200 | 200 | 3,80 |
| **Bank of Montreal** | | | |
| 1,802 % fällig am 12.07.2019 CAD | 200 | $ 153 | 2,91 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **C.I.B.C.** | | | |
| 1,802 % fällig am 12.07.2019 | 100 | 76 | 1,44 |
| **Florida Power & Light** | | | |
| 2,460 % fällig am 18.07.2019 $ | 250 | 250 | 4,75 |
| **HSBC Bank Canada** | | | |
| 1,854 % fällig am 11.07.2019 CAD | 200 | 153 | 2,90 |
| **Royal Bank of Canada** | | | |
| 1,801 % fällig am 11.07.2019 | 200 | 153 | 2,90 |
| **Royal Caribbean Cruise** | | | |
| 2,850 % fällig am 30.07.2019 $ | 100 | 100 | 1,90 |
| **Toronto-Dominion Bank** | | | |
| 1,792 % fällig am 26.07.2019 CAD | 300 | 229 | 4,35 |
| **Virginia Electric & Power Co.** | | | |
| 2,590 % fällig am 05.08.2019 $ | 250 | 249 | 4,73 |
| | | 1.563 | 29,68 |
| | | 7 | 0,13 |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | |
| **Federal Home Loan Bank** | | | |
| 2,243 % fällig am 16.08.2019 (b)(c) | 600 | 598 | 11,35 |
| 2,299 % fällig am 07.08.2019 (b)(c) | 300 | 299 | 5,68 |
| 2,314 % fällig am 11.09.2019 (b)(c) | 100 | 100 | 1,90 |
| | | 997 | 18,93 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 2.567 | 48,74 |
| **AKTIEN** | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)** | 11.558 | 116 | 2,20 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 5.936** | **112,68** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 3 | $ (8) | (0,15) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ (8)** | **(0,15)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[(1)]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[(2)] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 900 | $ 3 | 0,07 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | **$ 3** | **0,07** |

(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**

**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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Erhalt | S&P 500 Total Return Index | 888 | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 5.195 | 15.01.2020 | $ 0 | $ 29 | $ 29 | 0,54 |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 09/2019 | PEN | 97 | $ | 29 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | (0,01) |
| JPM | 07/2019 | CAD | 300 | | 228 | 0 | (2) | (2) | (0,04) |
| SCX | 07/2019 | | 700 | | 525 | 0 | (11) | (11) | (0,20) |
| | | | | | | $ 0 | $ (13) | $ (13) | (0,25) |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$** | **16** | **0,29** |
| **Summe Anlagen** | **$** | **5.947** | **112,89** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$** | **(679)** | **(12,89)** |
| **Nettovermögen** | **$** | **5.268** | **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 56 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**(f)** **Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 1,350 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 7 | U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.08.2021 | $ (10) | $ 7 | $ 7 | 0,13 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (10)** | **$ 7** | **$ 7** | **0,13** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 502 | $ 5.434 | $ 0 | $ 5.936 |
| Finanzderivate[3] | (8) | 19 | 0 | 11 |
| **Summen** | **$ 494** | **$ 5.453** | **$ 0** | **$ 5.947** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| GST | $ 29 | $ 0 | $ 29 |
| JPM | (2) | 0 | (2) |
| SCX | (11) | 0 | (11) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) [1] |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 31,57 | k. A. |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 80,98 | k. A. |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,13 | k. A. |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,15) | k. A. |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,07 | k. A. |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,29 | k. A. |

[1] Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund wurde am 29. März 2019 aufgelegt.

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | |
| **Advanz Pharma Corp.** | | | |
| 7,911 % fällig am 06.09.2024 | $ 296 | $ 284 | 0,03 |
| **Altice France S.A.** | | | |
| 6,394 % fällig am 14.08.2026 | 299 | 293 | 0,03 |
| **Aramark Services, Inc.** | | | |
| 4,080 % fällig am 11.03.2025 | 93 | 93 | 0,01 |
| **Avantor, Inc.** | | | |
| 5,402 % fällig am 21.11.2024 | 19 | 19 | 0,00 |
| **Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC** | | | |
| 4,133 % fällig am 15.01.2025 | 2.524 | 2.523 | 0,23 |
| **Axalta Coating Systems U.S. Holdings, Inc.** | | | |
| 4,080 % fällig am 01.06.2024 | 30 | 29 | 0,00 |
| **Bausch Health Cos., Inc.** | | | |
| 5,162 % fällig am 27.11.2025 | 141 | 140 | 0,01 |
| **Beacon Roofing Supply, Inc.** | | | |
| 4,663 % fällig am 02.01.2025 | 30 | 29 | 0,00 |
| **BWAY Holding Co.** | | | |
| 5,854 % fällig am 03.04.2024 | 39 | 38 | 0,00 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | |
| 5,152 % fällig am 22.12.2024 | 394 | 387 | 0,04 |
| **CenturyLink, Inc.** | | | |
| 5,152 % fällig am 31.01.2025 | 346 | 339 | 0,03 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | |
| 4,330 % fällig am 30.04.2025 | 98 | 98 | 0,01 |
| **CommScope, Inc.** | | | |
| 5,652 % fällig am 06.04.2026 | 200 | 200 | 0,02 |
| **Core & Main LP** | | | |
| 5,520 % fällig am 01.08.2024 | 30 | 30 | 0,00 |
| **CSC Holdings LLC** | | | |
| 4,894 % fällig am 25.01.2026 | 99 | 98 | 0,01 |
| **DaVita, Inc.** | | | |
| 5,135 % fällig am 24.06.2021 | 95 | 95 | 0,01 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 4,410 % fällig am 07.09.2023 | 180 | 180 | 0,02 |
| **Delos Finance SARL** | | | |
| 4,080 % fällig am 06.10.2023 | 4 | 4 | 0,00 |
| **Diamond Resorts Corp.** | | | |
| 6,152 % fällig am 02.09.2023 | 648 | 614 | 0,06 |
| **Envision Healthcare Corp.** | | | |
| 6,152 % fällig am 10.10.2025 | 597 | 520 | 0,05 |
| **Financial & Risk U.S. Holdings, Inc.** | | | |
| 3,773 % - 4,000 % fällig am 01.10.2025 | 1.113 | 1.082 | 0,10 |
| **First Data Corp.** | | | |
| 4,404 % fällig am 08.07.2022 | 54 | 54 | 0,01 |
| **Forest City Enterprises, L.P.** | | | |
| 6,402 % fällig am 07.12.2025 | 100 | 100 | 0,01 |
| **Gray Television, Inc.** | | | |
| 4,931 % fällig am 02.01.2026 | 100 | 99 | 0,01 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 4,080 % fällig am 17.03.2023 | 82 | 82 | 0,01 |
| 4,330 % fällig am 13.03.2025 | 6 | 6 | 0,00 |
| **Hilton Worldwide Finance LLC** | | | |
| 4,154 % fällig am 25.10.2023 | 326 | 326 | 0,03 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | |
| TBD % fällig am 01.05.2020 ^ | 100 | 100 | 0,01 |
| 6,579 % fällig am 01.05.2026 | 3.277 | 3.285 | 0,30 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | |
| 6,154 % fällig am 27.11.2023 | 82 | 81 | 0,01 |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | |
| 4,152 % fällig am 27.03.2025 | 111 | 111 | 0,01 |
| **Marriott Ownership Resorts, Inc.** | | | |
| 4,652 % fällig am 29.08.2025 | 50 | 50 | 0,00 |
| **McDermott Technology Americas, Inc.** | | | |
| 7,402 % fällig am 12.05.2025 | 822 | 810 | 0,07 |
| **Messer Industrie GmbH** | | | |
| 4,830 % fällig am 01.03.2026 | 140 | 138 | 0,01 |
| **MGM Growth Properties Operating Partnership LP** | | | |
| 4,402 % fällig am 21.03.2025 | 68 | 67 | 0,01 |
| **MH Sub LLC** | | | |
| 6,152 % fällig am 13.09.2024 | 88 | 87 | 0,01 |
| **Ministry of Finance of Tanzania** | | | |
| 7,741 % fällig am 10.12.2019 | $ 100 | $ 101 | 0,01 |
| **Multi Color Corp.** | | | |
| 6,750 % fällig am 31.10.2024 | 13 | 13 | 0,00 |
| **NCI Building Systems, Inc.** | | | |
| 6,354 % fällig am 12.04.2025 | 298 | 291 | 0,03 |
| **Neiman Marcus Group Ltd. LLC** | | | |
| 7,972 % fällig am 25.10.2023 | 1.132 | 993 | 0,09 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics S.A.** | | | |
| 5,680 % fällig am 30.06.2025 | 18 | 17 | 0,00 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | |
| TBD % fällig am 22.02.2049 ^ | 422 | 411 | 0,04 |
| 2,440 % - 4,690 % fällig am 31.12.2020 | 107 | 107 | 0,01 |
| **Panther BF Aggregator LP** | | | |
| 5,902 % fällig am 30.04.2026 | 100 | 99 | 0,01 |
| **PetSmart, Inc.** | | | |
| 6,670 % fällig am 11.03.2022 | 224 | 218 | 0,02 |
| **PG&E Corp.** | | | |
| 1,125 % fällig am 31.12.2020 | 36 | 36 | 0,00 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | |
| 4,404 % fällig am 24.05.2024 | 24 | 24 | 0,00 |
| **RPI Finance Trust** | | | |
| 4,402 % fällig am 27.03.2023 | 57 | 57 | 0,01 |
| **Sequa Mezzanine Holdings LLC** | | | |
| 7,560 % fällig am 28.11.2021 | 1.177 | 1.153 | 0,11 |
| 11,583 % fällig am 28.04.2022 | 157 | 151 | 0,01 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 4,938 % fällig am 02.02.2024 | 391 | 386 | 0,04 |
| **SS&C Technologies Holdings Europe SARL** | | | |
| 4,652 % fällig am 16.04.2025 | 84 | 84 | 0,01 |
| **SS&C Technologies, Inc.** | | | |
| 4,652 % fällig am 16.04.2025 | 132 | 131 | 0,01 |
| **Starfruit Finco BV** | | | |
| 5,669 % fällig am 01.10.2025 | 300 | 296 | 0,03 |
| **Syniverse Holdings, Inc.** | | | |
| 7,401 % fällig am 09.03.2023 | 162 | 150 | 0,01 |
| **TEX Operations Co. LLC** | | | |
| 4,402 % fällig am 04.08.2023 | 39 | 39 | 0,00 |
| **Unitymedia Finance LLC** | | | |
| 4,644 % fällig am 15.01.2026 | 100 | 100 | 0,01 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | |
| 2,750 % fällig am 15.01.2027 | € 200 | 228 | 0,02 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | |
| 5,152 % fällig am 15.03.2024 | $ 1.213 | 1.157 | 0,11 |
| **Valeant Pharmaceuticals International, Inc.** | | | |
| 5,412 % fällig am 02.06.2025 | 13 | 13 | 0,00 |
| **West Corp.** | | | |
| 6,522 % fällig am 10.10.2024 | 24 | 22 | 0,00 |
| **Wyndham Hotels & Resorts, Inc.** | | | |
| 4,152 % fällig am 30.05.2025 | 99 | 99 | 0,01 |
| | | 18.867 | 1,75 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € 329 | 379 | 0,04 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | $ 150 | 154 | 0,01 |
| **AIB Group PLC** | | | |
| 4,263 % fällig am 10.04.2025 | 800 | 824 | 0,08 |
| 4,750 % fällig am 12.10.2023 | 200 | 210 | 0,02 |
| **Air Lease Corp.** | | | |
| 3,250 % fällig am 01.03.2025 | 1.600 | 1.611 | 0,15 |
| **Akelius Residential Property AB** | | | |
| 3,375 % fällig am 23.09.2020 | € 100 | 119 | 0,01 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | $ 6 | 6 | 0,00 |
| 3,875 % fällig am 21.05.2024 | 192 | 197 | 0,02 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | 150 | 152 | 0,01 |
| 4,250 % fällig am 15.04.2021 | 1.100 | 1.125 | 0,10 |
| 4,625 % fällig am 19.05.2022 | 20 | 21 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2020 | 75 | 78 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | 41 | 55 | 0,01 |
| **Ambac LSNI LLC** | | | |
| 7,319 % fällig am 12.02.2023 | 867 | 883 | 0,08 |
| **American International Group, Inc.** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.04.2048 | $ 142 | $ 146 | 0,01 |
| **American Tower Corp.** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.06.2023 | 78 | 79 | 0,01 |
| **Annington Funding PLC** | | | |
| 1,650 % fällig am 12.07.2024 | € 100 | 117 | 0,01 |
| 2,646 % fällig am 12.07.2025 | £ 200 | 258 | 0,02 |
| **Ardonagh Midco PLC** | | | |
| 8,375 % fällig am 15.07.2023 | 400 | 468 | 0,04 |
| **Aroundtown S.A.** | | | |
| 2,000 % fällig am 02.11.2026 | € 100 | 120 | 0,01 |
| **Assurant, Inc.** | | | |
| 4,200 % fällig am 27.09.2023 | $ 62 | 65 | 0,01 |
| **Athene Holding Ltd.** | | | |
| 4,125 % fällig am 12.01.2028 | 50 | 50 | 0,00 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € 400 | 491 | 0,05 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2023 | $ 150 | 159 | 0,02 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | 168 | 180 | 0,02 |
| **AXA Equitable Holdings, Inc.** | | | |
| 3,900 % fällig am 20.04.2023 | 24 | 25 | 0,00 |
| 4,350 % fällig am 20.04.2028 | 59 | 62 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 20.04.2048 | 86 | 89 | 0,01 |
| **Banca Carige SpA** | | | |
| 1,090 % fällig am 25.02.2021 | € 2.800 | 3.202 | 0,30 |
| 1,389 % fällig am 25.10.2021 | 700 | 806 | 0,08 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** | | | |
| 2,000 % fällig am 29.01.2024 | 400 | 471 | 0,04 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (h)(j) | 200 | 234 | 0,02 |
| **Banco de Galicia y Buenos Aires S.A.** | | | |
| 25,980 % fällig am 26.04.2020 | ARS 4.000 | 67 | 0,01 |
| **Banco Espirito Santo S.A.** | | | |
| 2,625 % fällig am 08.05.2017 ^ | € 100 | 28 | 0,00 |
| **Banco Santander S.A.** | | | |
| 4,750 % fällig am 19.03.2025 (h)(j) | 600 | 647 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (h)(j) | 400 | 480 | 0,04 |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 2,999 % fällig am 25.06.2022 | $ 390 | 391 | 0,04 |
| 3,752 % fällig am 20.01.2023 | 120 | 121 | 0,01 |
| **Bank of Ireland** | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (h)(j) | € 300 | 361 | 0,03 |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (j) | $ 1.430 | 1.562 | 0,15 |
| **Barclays PLC** | | | |
| 1,500 % fällig am 03.09.2023 | € 200 | 234 | 0,02 |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | £ 300 | 382 | 0,04 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | 1.300 | 1.704 | 0,16 |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | 200 | 260 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 17.01.2033 | 200 | 249 | 0,02 |
| 3,684 % fällig am 10.01.2023 | $ 200 | 203 | 0,02 |
| 3,905 % fällig am 16.05.2024 | 400 | 394 | 0,04 |
| 4,209 % fällig am 10.01.2023 | 200 | 201 | 0,02 |
| 4,338 % fällig am 16.05.2024 | 400 | 413 | 0,04 |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | 200 | 213 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (h)(j) | € 600 | 692 | 0,06 |
| 7,000 % fällig am 15.09.2019 (h)(j) | £ 1.200 | 1.542 | 0,14 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (h)(j) | 200 | 266 | 0,02 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (h)(j) | 1.200 | 1.594 | 0,15 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (h)(j) | $ 1.200 | 1.231 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 15.03.2022 (h)(j) | 200 | 210 | 0,02 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (h)(j) | £ 1.700 | 2.297 | 0,21 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (h)(j) | $ 600 | 630 | 0,06 |
| **Bevco Lux SARL** | | | |
| 1,750 % fällig am 09.02.2023 | € 300 | 354 | 0,03 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | |
| 5,375 % fällig am 24.07.2023 | $ 44 | 46 | 0,00 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | |
| 1,400 % fällig am 06.07.2022 | € 200 | 233 | 0,02 |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | 100 | 120 | 0,01 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | |
| 3,375 % fällig am 09.01.2025 | $ 600 | 611 | 0,06 |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | 200 | 217 | 0,02 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | |
| 3,626 % fällig am 02.05.2021 | 200 | 201 | 0,02 |
| **Boston Properties LP** | | | |
| 3,200 % fällig am 15.01.2025 | 20 | 20 | 0,00 |

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

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Brighthouse Financial, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 22.06.2027 | $ | 62 | $ 59 | 0,01 |
| **Brixmor Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,629 % fällig am 01.02.2022 | | 170 | 170 | 0,02 |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 25.01.2028 | | 86 | 88 | 0,01 |
| 4,700 % fällig am 20.09.2047 | | 168 | 176 | 0,02 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2024 | | 100 | 103 | 0,01 |
| **Castellum AB** | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | € | 300 | 362 | 0,03 |
| **CBL & Associates LP** | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.12.2026 | $ | 158 | 109 | 0,01 |
| **China Construction Bank Corp.** | | | | |
| 0,262 % fällig am 24.09.2021 | € | 300 | 342 | 0,03 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.03.2021 | $ | 64 | 65 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 260 | 277 | 0,03 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 3,531 % fällig am 24.07.2023 | | 216 | 217 | 0,02 |
| 3,540 % fällig am 25.04.2022 | | 57 | 57 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 17.05.2024 | | 100 | 101 | 0,01 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 4,625 % fällig am 29.12.2025 (h)(j) | € | 400 | 489 | 0,05 |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (h)(j) | | 400 | 475 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (h)(j) | | 5.000 | 6.316 | 0,59 |
| **Corestate Capital Holding S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.04.2023 | | 700 | 799 | 0,07 |
| **Corp. Andina de Fomento** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.10.2021 (g) | MXN | 1.565 | 80 | 0,01 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | € | 500 | 578 | 0,05 |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | | 200 | 234 | 0,02 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (j) | $ | 515 | 568 | 0,05 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | | 1.920 | 1.981 | 0,18 |
| 4,282 % fällig am 09.01.2028 | | 250 | 264 | 0,02 |
| 7,250 % fällig am 12.09.2025 (h)(j) | | 200 | 215 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (h)(j) | | 400 | 428 | 0,04 |
| **CTR Partnership LP** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2025 | | 50 | 52 | 0,00 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,375 % fällig am 18.01.2021 | € | 4.100 | 4.620 | 0,43 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 800 | 919 | 0,09 |
| 1,875 % fällig am 14.02.2022 | | 800 | 925 | 0,09 |
| 2,700 % fällig am 13.07.2020 | $ | 138 | 137 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 22.01.2021 | | 100 | 99 | 0,01 |
| 3,567 % fällig am 13.07.2020 | | 149 | 148 | 0,01 |
| 3,855 % fällig am 04.02.2021 | | 300 | 298 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 04.02.2021 | | 400 | 404 | 0,04 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 2.670 | 2.708 | 0,25 |
| **Digital Realty Trust LP** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.07.2029 | | 242 | 246 | 0,02 |
| 3,700 % fällig am 15.08.2027 | | 8 | 8 | 0,00 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (e) | € | 71 | 78 | 0,01 |
| **EPR Properties** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.06.2027 | $ | 200 | 209 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 15.12.2026 | | 22 | 23 | 0,00 |
| 4,950 % fällig am 15.04.2028 | | 24 | 26 | 0,00 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.03.2024 | € | 100 | 119 | 0,01 |
| 2,875 % fällig am 01.02.2026 | | 100 | 120 | 0,01 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | | 200 | 244 | 0,02 |
| 4,850 % fällig am 17.04.2028 | $ | 65 | 69 | 0,01 |
| **Fastighets AB Balder** | | | | |
| 1,125 % fällig am 14.03.2022 | € | 300 | 349 | 0,03 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 24.06.2021 | | 700 | 816 | 0,08 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | $ | 200 | 201 | 0,02 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 0,121 % fällig am 14.05.2021 | € | 100 | 113 | 0,01 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | $ | 596 | 615 | 0,06 |
| 6,750 % fällig am 15.03.2022 | | 742 | 773 | 0,07 |
| **GE Capital European Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 20.07.2020 | € | 1.000 | $ 1.167 | 0,11 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 13.09.2023 | £ | 100 | 138 | 0,01 |
| 4,375 % fällig am 31.07.2019 | | 18 | 23 | 0,00 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 20.06.2022 | € | 200 | 242 | 0,02 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2025 | $ | 55 | 59 | 0,01 |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | | 202 | 218 | 0,02 |
| **Goodman U.S. Finance Three LLC** | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.03.2028 | | 130 | 132 | 0,01 |
| **Grainger PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2028 | £ | 100 | 132 | 0,01 |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** | | | | |
| 5,800 % fällig am 21.02.2022 | $ | 200 | 201 | 0,02 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 30.05.2022 | | 750 | 758 | 0,07 |
| **Howard Hughes Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.03.2025 | | 92 | 96 | 0,01 |
| **HSBC Bank Argentina S.A.** | | | | |
| 25,250 % fällig am 27.09.2019 | ARS | 1.704 | 37 | 0,00 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.05.2030 | £ | 200 | 262 | 0,02 |
| 3,033 % fällig am 22.11.2023 | $ | 300 | 304 | 0,03 |
| 3,086 % fällig am 11.09.2021 | | 800 | 801 | 0,07 |
| 3,120 % fällig am 18.05.2021 | | 400 | 400 | 0,04 |
| 3,520 % fällig am 18.05.2024 | | 200 | 201 | 0,02 |
| 3,600 % fällig am 25.05.2023 | | 280 | 292 | 0,03 |
| 3,816 % fällig am 12.09.2026 | | 400 | 401 | 0,04 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 400 | 418 | 0,04 |
| 4,292 % fällig am 12.09.2026 | | 400 | 426 | 0,04 |
| 4,750 % fällig am 04.07.2029 (h)(j) | € | 200 | 240 | 0,02 |
| 5,250 % fällig am 16.09.2022 (h)(j) | | 500 | 615 | 0,06 |
| 5,875 % fällig am 28.09.2026 (h)(j) | £ | 400 | 536 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (h)(j) | € | 1.500 | 1.975 | 0,18 |
| 6,500 % fällig am 23.03.2028 (h)(j) | $ | 530 | 556 | 0,05 |
| **Hudson Pacific Properties LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.11.2027 | | 27 | 28 | 0,00 |
| **Hunt Cos., Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2026 | | 26 | 25 | 0,00 |
| **IMMOFINANZ AG** | | | | |
| 2,625 % fällig am 27.01.2023 | € | 200 | 238 | 0,02 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 3,320 % fällig am 02.10.2023 | $ | 200 | 200 | 0,02 |
| 4,100 % fällig am 02.10.2023 | | 400 | 423 | 0,04 |
| 4,550 % fällig am 02.10.2028 | | 200 | 220 | 0,02 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 760 | 820 | 0,08 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2022 | | 178 | 203 | 0,02 |
| **iStar, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.09.2020 | | 10 | 10 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 15.09.2022 | | 14 | 14 | 0,00 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 3,012 % fällig am 18.06.2022 | | 1.500 | 1.503 | 0,14 |
| 3,480 % fällig am 25.04.2023 | | 314 | 316 | 0,03 |
| **KBC Group NV** | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (h)(j) | € | 200 | 224 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 05.03.2024 (h)(j) | | 400 | 484 | 0,05 |
| **Kennedy-Wilson, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.04.2024 | $ | 74 | 76 | 0,01 |
| **Kojamo Oyj** | | | | |
| 1,500 % fällig am 19.06.2024 | € | 100 | 118 | 0,01 |
| 1,625 % fällig am 07.03.2025 | | 100 | 118 | 0,01 |
| **KSA Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,894 % fällig am 20.04.2022 | $ | 600 | 607 | 0,06 |
| **Liberty Living Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 28.11.2024 | £ | 100 | 129 | 0,01 |
| **Life Storage LP** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.12.2027 | $ | 24 | 25 | 0,00 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 3,055 % fällig am 07.05.2021 | | 200 | 200 | 0,02 |
| 3,300 % fällig am 07.05.2021 | | 600 | 610 | 0,06 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | £ | 100 | 128 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 07.03.2025 | AUD | 400 | 297 | 0,03 |
| 4,050 % fällig am 16.08.2023 | $ | 400 | 418 | 0,04 |
| 4,375 % fällig am 22.03.2028 | $ | 200 | $ 213 | 0,02 |
| 4,450 % fällig am 08.05.2025 | | 200 | 213 | 0,02 |
| 4,550 % fällig am 16.08.2028 | | 200 | 216 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 27.09.2025 (h)(j) | | 400 | 421 | 0,04 |
| **LoanCore Capital Markets LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.06.2020 | | 3.700 | 3.684 | 0,34 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | € | 500 | 589 | 0,05 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | | 500 | 608 | 0,06 |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | | 100 | 126 | 0,01 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,622 % fällig am 26.04.2023 | $ | 290 | 295 | 0,03 |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 400 | 409 | 0,04 |
| 4,302 % fällig am 08.03.2029 | | 400 | 419 | 0,04 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | € | 400 | 458 | 0,04 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 26.10.2020 | $ | 8 | 8 | 0,00 |
| 5,625 % fällig am 01.08.2033 | | 145 | 121 | 0,01 |
| 5,875 % fällig am 25.03.2021 | | 500 | 521 | 0,05 |
| 6,500 % fällig am 15.06.2022 | | 277 | 295 | 0,03 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 180 | 187 | 0,02 |
| **Newmark Group, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.11.2023 | | 110 | 116 | 0,01 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.04.2027 | | 2.340 | 2.449 | 0,23 |
| **Oppenheimer Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.07.2022 | | 30 | 31 | 0,00 |
| **Physicians Realty LP** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.01.2028 | | 51 | 51 | 0,00 |
| **Provident Funding Associates LP** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.06.2025 | | 18 | 17 | 0,00 |
| **Qatari Diar Finance Co.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 21.07.2020 | | 600 | 615 | 0,06 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | | 1.000 | 1.020 | 0,09 |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 4.400 | 4.411 | 0,41 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 3.100 | 3.108 | 0,29 |
| **RCI Banque S.A.** | | | | |
| 0,250 % fällig am 12.07.2021 | € | 100 | 114 | 0,01 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 08.03.2023 | | 200 | 235 | 0,02 |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 940 | 1.113 | 0,10 |
| 2,500 % fällig am 22.03.2023 | | 1.200 | 1.452 | 0,14 |
| 3,125 % fällig am 28.03.2027 | £ | 400 | 518 | 0,05 |
| 3,498 % fällig am 15.05.2023 | $ | 223 | 226 | 0,02 |
| 3,899 % fällig am 25.06.2024 | | 200 | 200 | 0,02 |
| 3,988 % fällig am 15.05.2023 | | 310 | 309 | 0,03 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 600 | 621 | 0,06 |
| 4,445 % fällig am 08.05.2030 | | 1.000 | 1.036 | 0,10 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | | 200 | 214 | 0,02 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 1.400 | 1.520 | 0,14 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (h)(j) | | 1.200 | 1.233 | 0,11 |
| 8,000 % fällig am 10.08.2025 (h)(j) | | 600 | 650 | 0,06 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (h)(j) | | 600 | 648 | 0,06 |
| **Sabra Health Care LP** | | | | |
| 4,800 % fällig am 01.06.2024 | | 36 | 37 | 0,00 |
| **Sagax AB** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.01.2024 | € | 200 | 237 | 0,02 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | $ | 784 | 796 | 0,07 |
| 3,500 % fällig am 07.06.2024 | | 133 | 135 | 0,01 |
| 3,700 % fällig am 28.03.2022 | | 32 | 33 | 0,00 |
| 4,400 % fällig am 13.07.2027 | | 43 | 45 | 0,00 |
| 4,450 % fällig am 03.12.2021 | | 130 | 135 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 17.07.2025 | | 200 | 213 | 0,02 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 2,920 % fällig am 08.05.2026 | £ | 100 | 130 | 0,01 |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | $ | 3.000 | 3.031 | 0,28 |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (h)(j) | £ | 200 | 266 | 0,02 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (h)(j) | | 254 | 344 | 0,03 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 3,140 % fällig am 01.06.2021 | $ | 200 | 200 | 0,02 |
| 3,400 % fällig am 01.06.2021 | | 400 | 407 | 0,04 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | | |
| 3,352 % fällig am 15.11.2019 | € | 500 | 577 | 0,05 |
| 5,717 % fällig am 16.06.2021 | $ | 1.600 | 1.668 | 0,16 |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | | 200 | 213 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **SL Green Operating Partnership LP** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.10.2022 | $ | 16 | $ | 16 | 0,00 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.07.2023 | | 1.100 | | 1.152 | 0,11 |
| **Societe Generale S.A.** | | | | | |
| 6,750 % fällig am 06.04.2028 (h)(j) | | 200 | | 198 | 0,02 |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (h)(j) | | 700 | | 728 | 0,07 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | | 2.400 | | 2.556 | 0,24 |
| 6,125 % fällig am 15.05.2022 | | 1.310 | | 1.412 | 0,13 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 172 | | 185 | 0,02 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 | | 38 | | 40 | 0,00 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | | 140 | | 154 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 01.10.2021 | | 100 | | 110 | 0,01 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 1.400 | | 1.507 | 0,14 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | | |
| 4,247 % fällig am 20.01.2023 | | 320 | | 331 | 0,03 |
| **Starwood Property Trust, Inc.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.03.2025 | | 38 | | 38 | 0,00 |
| **Stearns Holdings LLC** | | | | | |
| 9,375 % fällig am 15.08.2020 | | 2.021 | | 1.930 | 0,18 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (h) | € | 100 | | 140 | 0,01 |
| **STORE Capital Corp.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2028 | $ | 42 | | 44 | 0,00 |
| 4,625 % fällig am 15.03.2029 | | 30 | | 32 | 0,00 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | | |
| 2,514 % fällig am 17.01.2020 | | 400 | | 400 | 0,04 |
| 2,938 % fällig am 17.01.2020 | | 400 | | 401 | 0,04 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 3,102 % fällig am 17.01.2023 | | 76 | | 77 | 0,01 |
| 3,328 % fällig am 17.01.2023 | | 280 | | 280 | 0,03 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | | | |
| 8,350 % fällig am 19.04.2023 | | 200 | | 205 | 0,02 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | | |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | £ | 291 | | 484 | 0,05 |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 1.021 | | 1.713 | 0,16 |
| **TLG Immobilien AG** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 27.11.2024 | € | 100 | | 116 | 0,01 |
| **TP ICAP PLC** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | £ | 500 | | 652 | 0,06 |
| **U.S. Capital Funding Ltd.** | | | | | |
| 2,864 % fällig am 10.07.2043 | $ | 7.006 | | 6.270 | 0,58 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (j) | | 250 | | 281 | 0,03 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 50 | | 53 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 19.02.2022 (h)(j) | € | 1.500 | | 1.884 | 0,18 |
| **UDR, Inc.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2028 | $ | 25 | | 26 | 0,00 |
| 4,625 % fällig am 10.01.2022 | | 6 | | 6 | 0,00 |
| **UniCredit SpA** | | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 3.650 | | 4.172 | 0,39 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | £ | 1.128 | | 1.614 | 0,15 |
| **VEREIT Operating Partnership LP** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.08.2027 | $ | 36 | | 37 | 0,00 |
| **VICI Properties LLC** | | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.10.2023 | | 257 | | 285 | 0,03 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | | |
| 0,250 % fällig am 16.10.2020 | € | 401 | | 458 | 0,04 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 07.09.2021 | £ | 100 | | 128 | 0,01 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | | |
| 0,140 % fällig am 06.07.2021 | € | 200 | | 227 | 0,02 |
| 0,250 % fällig am 16.02.2021 | | 320 | | 366 | 0,03 |
| 0,500 % fällig am 20.06.2022 | | 100 | | 114 | 0,01 |
| 1,000 % fällig am 16.02.2023 | | 76 | | 88 | 0,01 |
| 1,500 % fällig am 19.06.2026 | | 200 | | 230 | 0,02 |
| **Vornado Realty LP** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2025 | $ | 30 | | 31 | 0,00 |
| **Voyager Aviation Holdings LLC** | | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.08.2021 | | 100 | | 102 | 0,01 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 3,465 % fällig am 11.02.2022 | | 3.000 | | 3.018 | 0,28 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | | | |
| 3,092 % fällig am 23.07.2021 | $ | 300 | $ | 300 | 0,03 |
| 3,325 % fällig am 23.07.2021 | | 300 | | 303 | 0,03 |
| **Welltower, Inc.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.04.2028 | | 61 | | 65 | 0,01 |
| **WeWork Cos., Inc.** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.05.2025 | | 88 | | 87 | 0,01 |
| **WP Carey, Inc.** | | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.07.2029 | | 18 | | 18 | 0,00 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.04.2027 | € | 100 | | 120 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 09.04.2026 | | 100 | | 122 | 0,01 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 18.04.2025 | £ | 100 | | 129 | 0,01 |
| | | | | 152.538 | 14,15 |

**INDUSTRIEWERTE**

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 31.07.2043 | | 100 | | 121 | 0,01 |
| 4,249 % fällig am 31.07.2043 | | 337 | | 436 | 0,04 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 100 | | 126 | 0,01 |
| **AbbVie, Inc.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.11.2021 | $ | 218 | | 222 | 0,02 |
| **Adient U.S. LLC** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.05.2026 | | 18 | | 19 | 0,00 |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 15.07.2027 | | 21 | | 21 | 0,00 |
| **Allied Universal Holdco LLC** | | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.07.2026 (b) | | 78 | | 79 | 0,01 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.02.2023 | € | 370 | | 435 | 0,04 |
| **Altice France S.A.** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.05.2024 | | 120 | | 142 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2024 | $ | 350 | | 362 | 0,03 |
| 7,375 % fällig am 01.05.2026 | | 3.000 | | 3.083 | 0,29 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.04.2031 | | 38 | | 38 | 0,00 |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 16.03.2026 | € | 200 | | 234 | 0,02 |
| **Arrow Electronics, Inc.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 08.09.2024 | $ | 23 | | 23 | 0,00 |
| **Avon International Capital PLC** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.08.2022 (b) | | 46 | | 46 | 0,00 |
| **B.C. Unlimited Liability Co.** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2024 | | 163 | | 165 | 0,02 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.05.2025 | | 100 | | 106 | 0,01 |
| 4,700 % fällig am 15.05.2028 | | 200 | | 214 | 0,02 |
| **Bausch Health Americas, Inc.** | | | | | |
| 8,500 % fällig am 31.01.2027 | | 48 | | 53 | 0,01 |
| **Bausch Health Cos., Inc.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.03.2022 | | 51 | | 53 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 15.01.2028 | | 32 | | 33 | 0,00 |
| 7,250 % fällig am 30.05.2029 | | 64 | | 67 | 0,01 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.07.2021 | | 10 | | 10 | 0,00 |
| 2,979 % fällig am 25.06.2021 | | 200 | | 199 | 0,02 |
| **BCPE Cycle Merger Sub, Inc.** | | | | | |
| 10,625 % fällig am 15.07.2027 | | 108 | | 110 | 0,01 |
| **Berry Global Escrow Corp.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.07.2026 | | 74 | | 76 | 0,01 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.04.2027 | | 238 | | 239 | 0,02 |
| **Boston Scientific Corp.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.05.2022 | | 330 | | 340 | 0,03 |
| **Broadcom Corp.** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.01.2023 | | 350 | | 345 | 0,03 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2022 | | 218 | | 219 | 0,02 |
| 3,625 % fällig am 15.01.2024 | | 44 | | 44 | 0,00 |
| 3,875 % fällig am 15.01.2027 | | 297 | | 291 | 0,03 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | | |
| 2,910 % fällig am 16.03.2020 | | 140 | | 140 | 0,01 |
| 3,040 % fällig am 15.03.2021 | | 110 | | 110 | 0,01 |
| **Catalent Pharma Solutions, Inc.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.07.2027 | | 12 | | 12 | 0,00 |
| **CB IDEARC, Inc.** | | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.09.2022 | $ | 676 | $ | 0 | 0,00 |
| 10,625 % fällig am 15.03.2023 | | 378 | | 0 | 0,00 |
| 11,250 % fällig am 01.03.2021 | | 524 | | 0 | 0,00 |
| **Celgene Corp.** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.08.2021 | | 210 | | 209 | 0,02 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,978 % fällig am 15.02.2022 | | 600 | | 599 | 0,06 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | | 3.494 | | 3.526 | 0,33 |
| 4,229 % fällig am 01.02.2024 | | 736 | | 740 | 0,07 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 20 | | 21 | 0,00 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 42 | | 46 | 0,00 |
| **Cigna Corp.** | | | | | |
| 2,760 % fällig am 17.03.2020 | | 450 | | 450 | 0,04 |
| **Clear Channel Communication, Inc.** | | | | | |
| 9,000 % fällig am 01.03.2021 | | 4.280 | | 0 | 0,00 |
| 11,250 % fällig am 01.03.2021 | | 120 | | 0 | 0,00 |
| **Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2022 | | 209 | | 214 | 0,02 |
| 9,250 % fällig am 15.02.2024 | | 539 | | 586 | 0,05 |
| **Cleveland-Cliffs, Inc.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2024 | | 30 | | 31 | 0,00 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2021 | | 1.175 | | 1.153 | 0,11 |
| 6,250 % fällig am 31.03.2023 | | 2.213 | | 2.138 | 0,20 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2026 | | 682 | | 658 | 0,06 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2024 | | 1.064 | | 1.067 | 0,10 |
| **DAE Funding LLC** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2020 | | 114 | | 114 | 0,01 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2022 | | 600 | | 611 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | | 355 | | 371 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 15.11.2021 | | 342 | | 356 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 15.11.2023 | | 401 | | 422 | 0,04 |
| **Davide Campari-Milano SpA** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 30.09.2020 | € | 100 | | 117 | 0,01 |
| **Diamond Resorts International, Inc.** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | $ | 589 | | 609 | 0,06 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | | 100 | | 101 | 0,01 |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | | 855 | | 860 | 0,08 |
| **DP World PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 25.09.2026 | € | 130 | | 155 | 0,01 |
| **Eagle Holding Co. LLC** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 (c) | $ | 44 | | 44 | 0,00 |
| **eBay, Inc.** | | | | | |
| 3,800 % fällig am 09.03.2022 | | 195 | | 202 | 0,02 |
| **EMC Corp.** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 3.510 | | 3.491 | 0,32 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.09.2023 | | 46 | | 48 | 0,00 |
| **EQT Corp.** | | | | | |
| 3,089 % fällig am 01.10.2020 | | 72 | | 72 | 0,01 |
| **Equifax, Inc.** | | | | | |
| 3,388 % fällig am 15.08.2021 | | 98 | | 98 | 0,01 |
| 3,600 % fällig am 15.08.2021 | | 34 | | 35 | 0,00 |
| **Eurofins Scientific SE** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 25.07.2024 | € | 100 | | 114 | 0,01 |
| **Exela Intermediate LLC** | | | | | |
| 10,000 % fällig am 15.07.2023 | $ | 78 | | 64 | 0,01 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 21.05.2027 | € | 100 | | 119 | 0,01 |
| 2,950 % fällig am 21.05.2039 | | 100 | | 127 | 0,01 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.07.2024 | $ | 269 | | 272 | 0,03 |
| 3,200 % fällig am 01.07.2026 | | 171 | | 175 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2029 | | 179 | | 184 | 0,02 |
| 4,400 % fällig am 01.07.2049 | | 83 | | 88 | 0,01 |
| **Flex Ltd.** | | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.06.2029 | | 108 | | 110 | 0,01 |
| **General Electric Co.** | | | | | |
| 2,200 % fällig am 09.01.2020 | | 76 | | 76 | 0,01 |
| 3,100 % fällig am 09.01.2023 | | 81 | | 82 | 0,01 |
| 3,150 % fällig am 07.09.2022 | | 20 | | 20 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 16.09.2020 | | 2 | | 2 | 0,00 |
| 5,550 % fällig am 04.05.2020 | | 33 | | 34 | 0,00 |
| 5,550 % fällig am 05.01.2026 | | 432 | | 483 | 0,05 |

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

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| 5,875 % fällig am 14.01.2038 | $ 16 | $ 18 | 0,00 |
| 6,150 % fällig am 07.08.2037 | 3 | 3 | 0,00 |
| **General Mills, Inc.** | | | |
| 3,141 % fällig am 16.04.2021 | 141 | 141 | 0,01 |
| **Go Daddy Operating Co. LLC** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.12.2027 | 62 | 64 | 0,01 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2022 | 2.670 | 2.919 | 0,27 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2030 | 128 | 132 | 0,01 |
| **Huntsman International LLC** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.05.2029 | 44 | 45 | 0,00 |
| **Hyundai Capital America** | | | |
| 3,202 % fällig am 18.09.2020 | 186 | 186 | 0,02 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | |
| 6,375 % fällig am 01.05.2026 | 749 | 799 | 0,07 |
| 8,375 % fällig am 01.05.2027 | 1.358 | 1.429 | 0,13 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,625 % PIK)** | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (c) | € 119 | 138 | 0,01 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,735 % PIK)** | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (c) | 195 | 228 | 0,02 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar und 6,750 % PIK)** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2027 (c) | $ 194 | 195 | 0,02 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar und 7,125 % PIK)** | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2029 (c) | 200 | 201 | 0,02 |
| **IHS Markit Ltd.** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.03.2026 | 7 | 7 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.11.2022 | 6 | 6 | 0,00 |
| **IMCD NV** | | | |
| 2,500 % fällig am 26.03.2025 | € 100 | 117 | 0,01 |
| **Incitec Pivot Finance LLC** | | | |
| 6,000 % fällig am 10.12.2019 | $ 22 | 22 | 0,00 |
| **Indonesia Asahan Aluminium Persero PT** | | | |
| 5,230 % fällig am 15.11.2021 | 200 | 211 | 0,02 |
| **Intelsat Connect Finance S.A.** | | | |
| 9,500 % fällig am 15.02.2023 | 170 | 151 | 0,01 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.08.2023 | 450 | 413 | 0,04 |
| 8,000 % fällig am 15.02.2024 | 561 | 586 | 0,05 |
| 8,500 % fällig am 15.10.2024 | 465 | 463 | 0,04 |
| 9,750 % fällig am 15.07.2025 | 278 | 285 | 0,03 |
| **Intelsat Luxembourg S.A.** | | | |
| 7,750 % fällig am 01.06.2021 ^ | 507 | 488 | 0,05 |
| **IQVIA, Inc.** | | | |
| 3,250 % fällig am 15.03.2025 | € 100 | 118 | 0,01 |
| **Keurig Dr Pepper, Inc.** | | | |
| 3,200 % fällig am 15.11.2021 | $ 1.894 | 1.915 | 0,18 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | |
| 6,850 % fällig am 15.02.2020 | 2.550 | 2.615 | 0,24 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | 60 | 61 | 0,01 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | |
| 5,327 % fällig am 06.02.2029 | 80 | 85 | 0,01 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | £ 30 | 43 | 0,00 |
| **NetApp, Inc.** | | | |
| 3,300 % fällig am 29.09.2024 | $ 66 | 67 | 0,01 |
| **Netflix, Inc.** | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2027 | € 200 | 249 | 0,02 |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | 476 | 589 | 0,06 |
| 4,625 % fällig am 15.05.2029 | 300 | 389 | 0,04 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | $ 120 | 128 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2022 | 46 | 49 | 0,01 |
| **Newcrest Finance Pty. Ltd.** | | | |
| 4,450 % fällig am 15.11.2021 | 32 | 33 | 0,00 |
| **Nokia Oyj** | | | |
| 4,375 % fällig am 12.06.2027 | 26 | 27 | 0,00 |
| **NXP BV** | | | |
| 3,875 % fällig am 18.06.2026 | 100 | 103 | 0,01 |
| 4,300 % fällig am 18.06.2029 | 100 | 103 | 0,01 |
| **ONEOK Partners LP** | | | |
| 3,375 % fällig am 01.10.2022 | 30 | 31 | 0,00 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2022 | 249 | 239 | 0,02 |
| **Outfront Media Capital LLC** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2027 | 77 | 79 | 0,01 |
| **Par Pharmaceutical, Inc.** | | | |
| 7,500 % fällig am 01.04.2027 | $ 150 | $ 148 | 0,01 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2021 | 921 | 931 | 0,09 |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | 393 | 407 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | 1.495 | 1.582 | 0,15 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2024 | 22 | 24 | 0,00 |
| **Pelabuhan Indonesia Persero PT** | | | |
| 4,500 % fällig am 02.05.2023 | 200 | 209 | 0,02 |
| **Petroleos de Venezuela S.A.** | | | |
| 5,375 % fällig am 12.04.2027 ^ | 707 | 113 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 12.04.2037 ^ | 762 | 126 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 16.05.2024 ^ | 642 | 103 | 0,01 |
| 6,000 % fällig am 15.11.2026 ^ | 518 | 83 | 0,01 |
| 9,750 % fällig am 17.05.2035 ^ | 280 | 70 | 0,01 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | |
| 5,500 % fällig am 21.01.2021 | 402 | 407 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 13.03.2027 | 260 | 257 | 0,02 |
| 6,750 % fällig am 21.09.2047 | 40 | 36 | 0,00 |
| **PetSmart, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2025 | 74 | 72 | 0,01 |
| **Phillips 66** | | | |
| 3,347 % fällig am 15.04.2020 | 100 | 100 | 0,01 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.12.2029 (b) | 58 | 58 | 0,01 |
| **QVC, Inc.** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2023 | 24 | 24 | 0,00 |
| 4,450 % fällig am 15.02.2025 | 111 | 112 | 0,01 |
| 4,850 % fällig am 01.04.2024 | 39 | 40 | 0,00 |
| 5,125 % fällig am 02.07.2022 | 35 | 36 | 0,00 |
| **Radiate Holdco LLC** | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2023 | 70 | 70 | 0,01 |
| **Refinitiv U.S. Holdings, Inc.** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2026 | € 700 | 817 | 0,08 |
| **Roadster Finance DAC** | | | |
| 2,375 % fällig am 08.12.2027 | 100 | 115 | 0,01 |
| **Rockpoint Gas Storage Canada Ltd.** | | | |
| 7,000 % fällig am 31.03.2023 | $ 10 | 10 | 0,00 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.03.2022 | 135 | 147 | 0,01 |
| **Sands China Ltd.** | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | 200 | 211 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | 200 | 215 | 0,02 |
| 5,400 % fällig am 08.08.2028 | 400 | 435 | 0,04 |
| **Sky Ltd.** | | | |
| 3,125 % fällig am 26.11.2022 | 8 | 8 | 0,00 |
| **SoftBank Group Corp.** | | | |
| 4,000 % fällig am 20.04.2023 | € 860 | 1.066 | 0,10 |
| **Spanish Broadcasting System, Inc.** | | | |
| 12,500 % fällig am 15.04.2017 ^ | $ 109 | 113 | 0,01 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | |
| 3,474 % fällig am 28.12.2031 | £ 1 | 1 | 0,00 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | $ 200 | 208 | 0,02 |
| 5,152 % fällig am 20.09.2029 | 800 | 826 | 0,08 |
| **Staples, Inc.** | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2026 | 157 | 156 | 0,01 |
| 10,750 % fällig am 15.04.2027 | 84 | 84 | 0,01 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | |
| 4,750 % fällig am 01.02.2028 | 20 | 21 | 0,00 |
| **Tech Data Corp.** | | | |
| 3,700 % fällig am 15.02.2022 | 115 | 117 | 0,01 |
| 4,950 % fällig am 15.02.2027 | 19 | 20 | 0,00 |
| **Tenet Healthcare Corp.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2024 | 160 | 163 | 0,02 |
| **Teva Pharmaceutical Finance BV** | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | 24 | 23 | 0,00 |
| **Teva Pharmaceutical Finance LLC** | | | |
| 2,250 % fällig am 18.03.2020 | 528 | 525 | 0,05 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | |
| 0,375 % fällig am 25.07.2020 | € 100 | 112 | 0,01 |
| 2,200 % fällig am 21.07.2021 | $ 426 | 406 | 0,04 |
| 3,250 % fällig am 15.04.2022 | € 400 | 451 | 0,04 |
| **Topaz Solar Farms LLC** | | | |
| 4,875 % fällig am 30.09.2039 | $ 88 | 88 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 30.09.2039 | 498 | 527 | 0,05 |
| **Triumph Group, Inc.** | | | |
| 4,875 % fällig am 01.04.2021 | $ 75 | $ 74 | 0,01 |
| 5,250 % fällig am 01.06.2022 | 37 | 36 | 0,00 |
| **United Group BV** | | | |
| 4,375 % fällig am 01.07.2022 | € 100 | 117 | 0,01 |
| 4,875 % fällig am 01.07.2024 | 100 | 119 | 0,01 |
| **United Technologies Corp.** | | | |
| 3,175 % fällig am 16.08.2021 | $ 82 | 82 | 0,01 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2023 | 376 | 369 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | 726 | 694 | 0,06 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | |
| 6,250 % fällig am 10.08.2026 | 188 | 215 | 0,02 |
| 6,875 % fällig am 21.11.2036 | 74 | 89 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 10.11.2039 | 50 | 60 | 0,01 |
| **ViaSat, Inc.** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2025 | 64 | 63 | 0,01 |
| 5,625 % fällig am 15.04.2027 | 71 | 74 | 0,01 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2027 | £ 100 | 132 | 0,01 |
| **VMware, Inc.** | | | |
| 2,300 % fällig am 21.08.2020 | $ 46 | 46 | 0,00 |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | 58 | 58 | 0,01 |
| 3,900 % fällig am 21.08.2027 | 50 | 51 | 0,01 |
| **VOC Escrow Ltd.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2028 | 57 | 58 | 0,01 |
| **Wabtec Corp.** | | | |
| 3,710 % fällig am 15.09.2021 | 111 | 111 | 0,01 |
| **Western Digital Corp.** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2026 | 276 | 271 | 0,03 |
| **Wind Tre SpA** | | | |
| 2,625 % fällig am 20.01.2023 | € 200 | 230 | 0,02 |
| 2,750 % fällig am 20.01.2024 | 200 | 225 | 0,02 |
| **Wyndham Destinations, Inc.** | | | |
| 3,900 % fällig am 01.03.2023 | $ 12 | 12 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 01.03.2022 | 4 | 4 | 0,00 |
| 5,400 % fällig am 01.04.2024 | 21 | 22 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 01.04.2027 | 64 | 67 | 0,01 |
| **Yara International ASA** | | | |
| 4,750 % fällig am 01.06.2028 | 12 | 13 | 0,00 |
| | | 60.642 | 5,63 |

**VERSORGUNGSUNTERNEHMEN**

| | | | |
|---|---|---|---|
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | 1.000 | 1.005 | 0,09 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | 150 | 151 | 0,01 |
| 4,900 % fällig am 15.08.2037 | 41 | 44 | 0,00 |
| **Edison International** | | | |
| 2,400 % fällig am 15.09.2022 | 56 | 53 | 0,01 |
| 2,950 % fällig am 15.03.2023 | 7 | 7 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 15.06.2027 | 49 | 53 | 0,01 |
| **Enable Midstream Partners LP** | | | |
| 4,950 % fällig am 15.05.2028 | 72 | 76 | 0,01 |
| **Frontier Communications Corp.** | | | |
| 8,000 % fällig am 01.04.2027 | 100 | 104 | 0,01 |
| **Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A.** | | | |
| 6,000 % fällig am 27.11.2023 | 700 | 762 | 0,07 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | € 500 | 611 | 0,06 |
| 5,999 % fällig am 23.01.2021 | $ 6 | 6 | 0,00 |
| 6,510 % fällig am 07.03.2022 | 702 | 759 | 0,07 |
| **ITC Holdings Corp.** | | | |
| 2,700 % fällig am 15.11.2022 | 36 | 36 | 0,00 |
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | 5 | 5 | 0,00 |
| **Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd.** | | | |
| 6,720 % fällig am 01.12.2022 | 39 | 37 | 0,00 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | |
| 2,450 % fällig am 15.08.2022 ^ | 337 | 325 | 0,03 |
| 2,950 % fällig am 01.03.2026 ^ | 1.171 | 1.104 | 0,10 |
| 3,250 % fällig am 15.09.2021 ^ | 227 | 222 | 0,02 |
| 3,250 % fällig am 15.06.2023 ^ | 464 | 452 | 0,04 |
| 3,300 % fällig am 15.03.2027 ^ | 224 | 214 | 0,02 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | 950 | 905 | 0,08 |
| 3,400 % fällig am 15.08.2024 ^ | 403 | 393 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2020 ^ | 721 | 707 | 0,07 |
| 3,500 % fällig am 15.06.2025 ^ | 564 | 546 | 0,05 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 3,750 % fällig am 15.02.2024 ^ | $ | 276 | $ 273 | 0,03 |
| 3,750 % fällig am 15.08.2042 ^ | | 20 | 18 | 0,00 |
| 3,850 % fällig am 15.11.2023 ^ | | 137 | 135 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2046 ^ | | 8 | 7 | 0,00 |
| 4,250 % fällig am 15.05.2021 ^ | | 210 | 208 | 0,02 |
| 4,300 % fällig am 15.03.2045 ^ | | 236 | 227 | 0,02 |
| 4,450 % fällig am 15.04.2042 ^ | | 11 | 11 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 15.12.2041 ^ | | 29 | 28 | 0,00 |
| 4,600 % fällig am 15.06.2043 ^ | | 56 | 55 | 0,01 |
| 4,750 % fällig am 15.02.2044 ^ | | 190 | 195 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 15.11.2043 ^ | | 177 | 182 | 0,02 |
| 5,400 % fällig am 15.01.2040 ^ | | 20 | 22 | 0,00 |
| 5,800 % fällig am 01.03.2037 ^ | | 201 | 221 | 0,02 |
| 6,050 % fällig am 01.03.2034 ^ | | 163 | 183 | 0,02 |
| 6,250 % fällig am 01.03.2039 ^ | | 114 | 129 | 0,01 |
| 6,350 % fällig am 15.02.2038 ^ | | 38 | 43 | 0,00 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.02.2029 | | 854 | 892 | 0,08 |
| 5,999 % fällig am 27.01.2028 | | 505 | 538 | 0,05 |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 441 | 473 | 0,04 |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | £ | 1.500 | 2.160 | 0,20 |
| 6,850 % fällig am 05.06.2115 | $ | 192 | 200 | 0,02 |
| 7,375 % fällig am 17.01.2027 | | 2.023 | 2.318 | 0,22 |
| 8,750 % fällig am 23.05.2026 | | 49 | 61 | 0,01 |
| **Public Service Enterprise Group, Inc.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 15.11.2021 | | 21 | 21 | 0,00 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | |
| 8,200 % fällig am 06.04.2028 | | 250 | 281 | 0,03 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.06.2047 | | 4 | 4 | 0,00 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 01.03.2028 | | 6 | 6 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 01.04.2035 | | 14 | 16 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2034 | | 4 | 5 | 0,00 |
| 6,650 % fällig am 01.04.2029 | | 41 | 47 | 0,01 |
| **Southern California Gas Co.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.11.2040 | | 6 | 7 | 0,00 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 1.800 | 1.870 | 0,17 |
| **Sprint Corp.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 500 | 533 | 0,05 |
| 7,625 % fällig am 01.03.2026 | | 47 | 50 | 0,01 |
| **Talen Energy Supply LLC** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 42 | 42 | 0,00 |
| **Transocean Phoenix Ltd.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.10.2024 | | 19 | 20 | 0,00 |
| **Transocean Sentry Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2023 | | 100 | 100 | 0,01 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 16.03.2037 | | 70 | 84 | 0,01 |
| | | | 20.242 | 1,88 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | 233.422 | 21,66 |

## WANDELANLEIHEN & WECHSEL

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Caesars Entertainment Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2024 | | 103 | 177 | 0,02 |

## KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015** | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.01.2042 | | 7 | 8 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2001** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.07.2031 ^ | | 170 | 127 | 0,01 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2004** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2025 ^ | | 30 | 22 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2029 ^ | | 35 | 26 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2007** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2027 ^ | | 100 | 75 | 0,01 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2028 ^ | | 5 | 4 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 01.07.2034 ^ | | 10 | 7 | 0,00 |
| 5,250 % fällig am 01.07.2037 ^ | | 30 | 22 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2008** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.07.2028 ^ | | 10 | 7 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2032 ^ | | 110 | 82 | 0,01 |
| 5,700 % fällig am 01.07.2023 ^ | | 45 | 34 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.07.2038 ^ | | 40 | 30 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2009** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.07.2038 ^ | $ | 20 | $ 15 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 01.07.2039 ^ | | 15 | 11 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2011** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.07.2030 ^ | | 45 | 32 | 0,00 |
| 5,750 % fällig am 01.07.2041 ^ | | 100 | 72 | 0,01 |
| 6,500 % fällig am 01.07.2040 ^ | | 10 | 7 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2012** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2041 ^ | | 410 | 241 | 0,02 |
| 5,125 % fällig am 01.07.2037 ^ | | 50 | 29 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2039 ^ | | 440 | 258 | 0,03 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2014** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.07.2035 ^ | | 700 | 364 | 0,04 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Notes, Series 2007** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.07.2017 ^ | | 30 | 22 | 0,00 |
| **Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Notes, Series 2012** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.07.2021 ^ | | 70 | 41 | 0,01 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 6,630 % fällig am 01.02.2035 | | 30 | 35 | 0,00 |
| 6,725 % fällig am 01.04.2035 | | 25 | 29 | 0,00 |
| 7,350 % fällig am 01.07.2035 | | 15 | 18 | 0,00 |
| **Illinois State General Obligation Bonds, Series 2003** | | | | |
| 5,100 % fällig am 01.06.2033 | | 335 | 353 | 0,03 |
| **Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.07.2040 ^ | | 200 | 159 | 0,02 |
| **Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007** | | | | |
| 7,467 % fällig am 01.06.2047 | | 800 | 808 | 0,08 |
| | | | 2.938 | 0,27 |

## US-REGIERUNGSBEHÖRDEN

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Fannie Mae** | | | |
| 5,220 % fällig am 25.07.2033 (a) | 102 | 17 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.12.2047 - 01.06.2049 | 3.448 | 3.552 | 0,33 |
| 4,000 % fällig am 01.12.2048 | 956 | 990 | 0,09 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2034 - 01.09.2049 | 16.000 | 16.150 | 1,50 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 56.700 | 57.951 | 5,38 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 122.500 | 126.579 | 11,75 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2048 - 01.05.2049 | 972 | 1.007 | 0,09 |
| 4,156 % fällig am 15.06.2042 (a) | 103 | 21 | 0,00 |
| **Freddie Mac UMBS** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2048 - 01.03.2049 | 1.476 | 1.534 | 0,14 |
| | | 207.801 | 19,28 |

## US-SCHATZOBLIGATIONEN

| | | | |
|---|---|---|---|
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.11.2046 | 2.200 | 2.355 | 0,22 |
| 3,000 % fällig am 15.11.2045 | 4.800 | 5.254 | 0,49 |
| 3,000 % fällig am 15.08.2048 | 20 | 22 | 0,00 |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049 | 3.500 | 3.845 | 0,36 |
| 3,125 % fällig am 15.02.2043 | 114 | 127 | 0,01 |
| 3,625 % fällig am 15.08.2043 | 372 | 449 | 0,04 |
| 3,625 % fällig am 15.02.2044 | 300 | 362 | 0,03 |
| 3,750 % fällig am 15.11.2043 | 160 | 197 | 0,02 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (g)** | | | |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 | 5.598 | 5.835 | 0,54 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 | 4.655 | 4.902 | 0,46 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 1,500 % fällig am 15.08.2026 | 200 | 195 | 0,02 |
| 1,750 % fällig am 15.05.2023 | 2.100 | 2.102 | 0,19 |
| 2,000 % fällig am 30.06.2024 | 9.600 | 9.705 | 0,90 |
| 2,125 % fällig am 29.02.2024 | 2.500 | 2.542 | 0,24 |
| 2,125 % fällig am 31.07.2024 | 200 | 204 | 0,02 |
| 2,125 % fällig am 15.05.2025 | $ 1.281 | $ 1.303 | 0,12 |
| 2,250 % fällig am 31.12.2023 | 11.890 | 12.148 | 1,13 |
| 2,250 % fällig am 31.01.2024 | 580 | 593 | 0,05 |
| 2,250 % fällig am 31.10.2024 | 18.400 | 18.832 | 1,75 |
| 2,250 % fällig am 15.11.2025 | 3.430 | 3.513 | 0,33 |
| 2,500 % fällig am 31.01.2025 | 200 | 207 | 0,02 |
| 2,625 % fällig am 31.03.2025 | 32.500 | 33.941 | 3,15 |
| 2,625 % fällig am 31.01.2026 | 14.900 | 15.610 | 1,45 |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 | 160 | 169 | 0,01 |
| 2,750 % fällig am 15.02.2028 | 600 | 638 | 0,06 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2028 | 120 | 129 | 0,01 |
| | | 125.179 | 11,62 |

## NON-AGENCY-MBS

| | | | |
|---|---|---|---|
| **American Home Mortgage Assets Trust** | | | |
| 3,424 % fällig am 25.11.2046 | 5.499 | 2.783 | 0,26 |
| **AREIT Trust** | | | |
| 5,501 % fällig am 14.02.2035 | 3.200 | 3.218 | 0,30 |
| **Banc of America Funding Corp.** | | | |
| 4,476 % fällig am 25.09.2048 | 4.650 | 4.738 | 0,44 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 4,154 % fällig am 20.05.2036 ^ | 70 | 69 | 0,01 |
| **Barclays Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 1,194 % fällig am 15.02.2033 (a) | 5.600 | 42 | 0,00 |
| 3,094 % fällig am 15.02.2033 | 2.005 | 1.989 | 0,18 |
| 3,444 % fällig am 15.02.2033 | 800 | 797 | 0,07 |
| 3,644 % fällig am 15.02.2033 | 600 | 597 | 0,06 |
| 4,444 % fällig am 15.02.2033 | 400 | 400 | 0,04 |
| 5,494 % fällig am 15.02.2033 | 2.400 | 2.405 | 0,22 |
| **BCAP LLC Trust** | | | |
| 4,489 % fällig am 26.03.2036 | 10 | 10 | 0,00 |
| **Bear Stearns Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.08.2036 | 2.204 | 2.176 | 0,20 |
| **CitiMortgage Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.12.2036 ^ | 415 | 399 | 0,04 |
| **Civic Mortgage LLC** | | | |
| 4,349 % fällig am 25.11.2022 | 71 | 71 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.06.2037 | 3.196 | 3.108 | 0,29 |
| 3,704 % fällig am 25.10.2035 ^ | 451 | 390 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 25.09.2035 ^ | 3.710 | 3.594 | 0,33 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 3,064 % fällig am 25.02.2035 | 1.260 | 1.160 | 0,11 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | |
| 6,500 % fällig am 25.11.2034 ^ | 576 | 578 | 0,05 |
| **Eurosail PLC** | | | |
| 1,489 % fällig am 13.09.2045 | £ 5.123 | 6.327 | 0,59 |
| 1,739 % fällig am 13.06.2045 | 2.740 | 3.465 | 0,32 |
| **GreenPoint Mortgage Funding Trust** | | | |
| 2,604 % fällig am 25.10.2046 | $ 800 | 785 | 0,07 |
| **Grifonas Finance PLC** | | | |
| 0,050 % fällig am 28.08.2039 | € 365 | 389 | 0,04 |
| **GSMPS Mortgage Loan Trust** | | | |
| 7,109 % fällig am 20.10.2032 | $ 2.339 | 2.416 | 0,22 |
| **GSMSC Resecuritization Trust** | | | |
| 5,515 % fällig am 26.04.2037 | 6.471 | 2.307 | 0,21 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 4,146 % fällig am 25.04.2037 | 88 | 80 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 3,194 % fällig am 15.06.2032 | 29 | 29 | 0,00 |
| 3,394 % fällig am 15.06.2032 | 100 | 99 | 0,01 |
| 3,644 % fällig am 15.06.2032 | 105 | 104 | 0,01 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 4,201 % fällig am 25.08.2036 ^ | 81 | 75 | 0,01 |
| 4,335 % fällig am 25.01.2037 ^ | 201 | 194 | 0,02 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 ^ | 0 | 2 | 0,00 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | |
| 2,954 % fällig am 25.09.2037 | 10.800 | 4.821 | 0,45 |
| **Morgan Stanley Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,664 % fällig am 25.04.2035 | 247 | 245 | 0,02 |
| 2,684 % fällig am 25.11.2035 | 24 | 24 | 0,00 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | |
| 1,760 % fällig am 15.05.2045 (b) | £ 13.900 | 17.703 | 1,64 |
| **RBSGC Mortgage Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | $ 58 | 53 | 0,00 |

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

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 2,614 % fällig am 25.06.2037 | $ 100 | $ 88 | 0,01 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | £ 4.766 | 6.059 | 0,56 |
| **Rochester Financing PLC** | | | |
| 2,081 % fällig am 18.06.2045 | 1.056 | 1.351 | 0,13 |
| **Sandwell Commercial Finance PLC** | | | |
| 1,874 % fällig am 30.09.2037 | 33 | 35 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,904 % fällig am 25.05.2035 ^ | $ 241 | 212 | 0,02 |
| 4,293 % fällig am 25.09.2035 | 117 | 104 | 0,01 |
| **Sutherland Commercial Mortgage Loans** | | | |
| 3,192 % fällig am 25.05.2037 | 1.646 | 1.635 | 0,15 |
| **Trinity Square PLC** | | | |
| 1,971 % fällig am 15.07.2051 | £ 54 | 69 | 0,01 |
| **Twin Bridges PLC** | | | |
| 1,573 % fällig am 12.09.2044 | 2.480 | 3.145 | 0,29 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,595 % fällig am 25.08.2046 | $ 1.324 | 1.266 | 0,12 |
| 3,302 % fällig am 25.12.2046 ^ | 4.600 | 4.273 | 0,40 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | |
| 1,775 % fällig am 21.09.2049 | £ 3.539 | 4.517 | 0,42 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,854 % fällig am 25.05.2035 ^ | $ 551 | 464 | 0,04 |
| **Wells Fargo Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,250 % fällig am 25.07.2037 ^ | 2.793 | 2.700 | 0,25 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,754 % fällig am 25.10.2036 ^ | 34 | 34 | 0,00 |
| 4,971 % fällig am 25.12.2034 | 3.855 | 3.982 | 0,37 |
| | | 97.576 | 9,05 |

**FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE**

| | | | |
|---|---|---|---|
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | |
| 2,544 % fällig am 25.07.2036 | 10.301 | 9.940 | 0,92 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 3,404 % fällig am 25.03.2035 ^ | 1.272 | 1.241 | 0,12 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,744 % fällig am 25.04.2036 | 4.800 | 4.767 | 0,44 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 3,379 % fällig am 25.07.2035 | 3.990 | 3.846 | 0,36 |
| **Arbor Realty Commercial Real Estate Notes Ltd.** | | | |
| 3,384 % fällig am 15.08.2027 | 9.300 | 9.315 | 0,86 |
| **Argent Securities Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.07.2036 | 8.096 | 7.061 | 0,66 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | |
| 3,229 % fällig am 25.08.2033 | 437 | 430 | 0,04 |
| **Basic Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,714 % fällig am 25.04.2036 | 836 | 838 | 0,08 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.10.2036 | 613 | 615 | 0,06 |
| **Castlelake Aircraft Securitization Trust** | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2043 | 1.507 | 1.521 | 0,14 |
| **Conseco Finance Corp.** | | | |
| 6,280 % fällig am 01.09.2030 | 1.679 | 1.795 | 0,17 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | |
| 2,624 % fällig am 25.05.2037 | 7.300 | 7.000 | 0,65 |
| 2,654 % fällig am 25.11.2047 ^ | 5.102 | 3.103 | 0,29 |
| 3,469 % fällig am 25.08.2035 | 4.088 | 4.140 | 0,38 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust** | | | |
| 2,744 % fällig am 25.05.2036 | 306 | 306 | 0,03 |
| 3,979 % fällig am 25.05.2034 | 634 | 619 | 0,06 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 3,570 % fällig am 25.01.2037 ^ | 206 | 92 | 0,01 |
| **Evans Grove CLO Ltd.** | | | |
| 3,441 % fällig am 28.05.2028 | 2.100 | 2.089 | 0,19 |
| **Fieldstone Mortgage Investment Trust** | | | |
| 2,550 % fällig am 25.11.2036 | 2.290 | 1.497 | 0,14 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,524 % fällig am 25.12.2036 | 8.073 | 7.774 | 0,72 |
| 2,744 % fällig am 25.01.2036 | 56 | 56 | 0,01 |
| 3,079 % fällig am 25.11.2035 | 1.500 | 1.499 | 0,14 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | 1.824 | 1.075 | 0,10 |
| 2,584 % fällig am 25.04.2036 | 866 | 840 | 0,08 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | |
| 3,647 % fällig am 15.07.2027 | $ 4.100 | $ 4.098 | 0,38 |
| 4,247 % fällig am 15.07.2027 | 800 | 797 | 0,07 |
| **GSAMP Trust** | | | |
| 2,774 % fällig am 25.03.2047 | 9.000 | 8.122 | 0,75 |
| **Harley Marine Financing LLC** | | | |
| 5,682 % fällig am 15.05.2043 | 289 | 240 | 0,02 |
| **Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.11.2036 | 5.875 | 4.833 | 0,45 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | |
| 2,554 % fällig am 25.08.2036 | 314 | 313 | 0,03 |
| 2,564 % fällig am 25.06.2036 | 143 | 143 | 0,01 |
| 2,654 % fällig am 25.07.2036 | 4.800 | 4.776 | 0,44 |
| **Legacy Mortgage Asset Trust** | | | |
| 4,180 % fällig am 28.01.2070 | 9.246 | 9.445 | 0,88 |
| **Lehman XS Trust** | | | |
| 3,204 % fällig am 25.10.2035 | 210 | 210 | 0,02 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,584 % fällig am 25.03.2046 | 5.034 | 4.070 | 0,38 |
| 2,704 % fällig am 25.01.2036 | 4.310 | 4.040 | 0,38 |
| 4,129 % fällig am 25.06.2034 | 696 | 693 | 0,06 |
| **LP Credit Card ABS Master Trust** | | | |
| 4,053 % fällig am 20.08.2024 | 1.839 | 1.822 | 0,17 |
| **Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust** | | | |
| 5,654 % fällig am 25.03.2032 | 2.584 | 2.635 | 0,24 |
| **Marlette Funding Trust** | | | |
| 3,710 % fällig am 15.12.2028 | 78 | 79 | 0,01 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,664 % fällig am 25.06.2036 | 623 | 563 | 0,05 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | |
| 2,514 % fällig am 25.02.2037 | 940 | 566 | 0,05 |
| 2,554 % fällig am 25.02.2037 | 2.915 | 1.766 | 0,16 |
| 2,654 % fällig am 25.03.2037 | 10.511 | 5.814 | 0,54 |
| 2,674 % fällig am 25.03.2036 | 3.633 | 3.623 | 0,34 |
| **Navient Student Loan Trust** | | | |
| 3,454 % fällig am 27.12.2066 | 4.637 | 4.667 | 0,43 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | |
| 3,184 % fällig am 25.03.2035 | 72 | 70 | 0,01 |
| 4,429 % fällig am 25.05.2034 ^ | 1.557 | 1.555 | 0,14 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | |
| 3,724 % fällig am 25.01.2036 ^ | 5.365 | 5.379 | 0,50 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 3,084 % fällig am 25.09.2034 | 394 | 396 | 0,04 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | |
| 4,934 % fällig am 25.08.2035 | 66 | 68 | 0,01 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | |
| 2,904 % fällig am 25.09.2035 | 157 | 158 | 0,01 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | |
| 2,644 % fällig am 25.09.2036 | 2.967 | 2.958 | 0,27 |
| 2,794 % fällig am 25.03.2036 | 2.000 | 1.982 | 0,18 |
| **Saxon Asset Securities Trust** | | | |
| 4,154 % fällig am 25.12.2037 | 3.871 | 3.904 | 0,36 |
| **SoFi Consumer Loan Program Trust** | | | |
| 3,200 % fällig am 25.08.2027 | 3.050 | 3.060 | 0,28 |
| **Soundview Home Loan Trust** | | | |
| 2,714 % fällig am 25.06.2036 ^ | 5.657 | 4.099 | 0,38 |
| 3,404 % fällig am 25.09.2037 | 8.374 | 6.757 | 0,63 |
| 3,439 % fällig am 25.05.2035 | 2.400 | 2.340 | 0,22 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | |
| 3,184 % fällig am 25.07.2035 | 220 | 221 | 0,02 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,574 % fällig am 25.12.2036 | 504 | 495 | 0,05 |
| 3,529 % fällig am 25.07.2035 | 1.220 | 1.229 | 0,11 |
| **Symphony CLO Ltd.** | | | |
| 3,877 % fällig am 14.07.2026 | 2.570 | 2.571 | 0,24 |
| **TruPS Financials Note Securitization Ltd.** | | | |
| 3,957 % fällig am 20.09.2039 | 3.274 | 3.242 | 0,30 |
| **VCL Multi-Compartment S.A.** | | | |
| 0,009 % fällig am 21.01.2025 | € 742 | 847 | 0,08 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | |
| 2,614 % fällig am 25.03.2037 | $ 23 | 22 | 0,00 |
| | | 176.127 | 16,34 |

**STAATSEMISSIONEN**

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Argentina Government International Bond** | | | |
| 3,375 % fällig am 15.01.2023 | € 200 | $ 178 | 0,02 |
| 3,380 % fällig am 31.12.2038 | 84 | 55 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 31.12.2038 | $ 1.996 | 1.173 | 0,11 |
| 3,875 % fällig am 15.01.2022 | € 1.370 | 1.281 | 0,12 |
| 4,625 % fällig am 11.01.2023 | $ 1.056 | 847 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | € 300 | 250 | 0,02 |
| 5,625 % fällig am 26.01.2022 | $ 280 | 237 | 0,02 |
| 5,875 % fällig am 11.01.2028 | 840 | 641 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 09.11.2047 | € 100 | 83 | 0,01 |
| 6,875 % fällig am 26.01.2027 | $ 300 | 241 | 0,02 |
| 6,875 % fällig am 11.01.2048 | 150 | 112 | 0,01 |
| 7,125 % fällig am 06.07.2036 | 700 | 543 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 22.04.2026 | 500 | 423 | 0,04 |
| 7,820 % fällig am 31.12.2033 | € 2.030 | 1.925 | 0,18 |
| 40,244 % fällig am 04.10.2022 | ARS 730 | 26 | 0,00 |
| 52,006 % fällig am 03.04.2022 (a) | 53.911 | 1.095 | 0,10 |
| 53.892 % fällig am 01.03.2020 (a) | 1.270 | 29 | 0,00 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | 278.772 | 6.420 | 0,60 |
| **Autonomous Community of Catalonia** | | | |
| 4,900 % fällig am 15.09.2021 | € 200 | 246 | 0,02 |
| **Croatia Government International Bond** | | | |
| 6,750 % fällig am 05.11.2019 | $ 600 | 608 | 0,06 |
| **Emirate of Abu Dhabi Government International Bond** | | | |
| 2,500 % fällig am 11.10.2022 | 300 | 303 | 0,03 |
| 3,125 % fällig am 11.10.2027 | 1.100 | 1.144 | 0,11 |
| **Export-Credit Bank of Turkey** | | | |
| 8,250 % fällig am 24.01.2024 | 200 | 209 | 0,02 |
| **Kuwait International Government Bond** | | | |
| 2,750 % fällig am 20.03.2022 | 481 | 488 | 0,04 |
| 3,500 % fällig am 20.03.2027 | 1.300 | 1.386 | 0,13 |
| **Peru Government International Bond** | | | |
| 5,400 % fällig am 12.08.2034 | PEN 159 | 49 | 0,00 |
| 5,700 % fällig am 12.08.2024 | 300 | 99 | 0,01 |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | 1.370 | 455 | 0,04 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | 11.727 | 3.924 | 0,36 |
| 6,350 % fällig am 12.08.2028 | 271 | 93 | 0,01 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | 14 | 5 | 0,00 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | 700 | 265 | 0,02 |
| **Qatar Government International Bond** | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ 400 | 420 | 0,04 |
| 5,103 % fällig am 23.04.2048 | 200 | 239 | 0,02 |
| **Republic of Greece Government International Bond** | | | |
| 3,500 % fällig am 30.01.2023 | € 31 | 38 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 30.01.2028 | 58 | 73 | 0,01 |
| 3,900 % fällig am 30.01.2033 | 61 | 78 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 30.01.2037 | 36 | 47 | 0,00 |
| 4,200 % fällig am 30.01.2042 | 11 | 15 | 0,00 |
| **Saudi Government International Bond** | | | |
| 2,875 % fällig am 04.03.2023 | $ 600 | 608 | 0,06 |
| 4,500 % fällig am 26.10.2046 | 600 | 611 | 0,06 |
| 4,625 % fällig am 04.10.2047 | 800 | 830 | 0,08 |
| 5,000 % fällig am 17.04.2049 | 700 | 768 | 0,07 |
| **Turkey Government International Bond** | | | |
| 4,625 % fällig am 31.03.2025 | € 800 | 910 | 0,08 |
| 5,625 % fällig am 30.03.2021 | $ 300 | 305 | 0,03 |
| 7,250 % fällig am 23.12.2023 | 1.100 | 1.139 | 0,11 |
| 7,625 % fällig am 26.04.2029 | 2.000 | 2.053 | 0,19 |
| **Venezuela Government International Bond** | | | |
| 6,000 % fällig am 09.12.2020 ^ | 289 | 78 | 0,01 |
| 7,000 % fällig am 31.03.2038 ^ | 107 | 28 | 0,00 |
| 7,650 % fällig am 21.04.2025 ^ | 266 | 72 | 0,01 |
| 8,250 % fällig am 13.10.2024 ^ | 269 | 74 | 0,01 |
| 9,000 % fällig am 07.05.2023 ^ | 144 | 40 | 0,00 |
| 9,250 % fällig am 15.09.2027 ^ | 301 | 88 | 0,01 |
| 9,250 % fällig am 07.05.2028 ^ | 256 | 70 | 0,01 |
| 11,750 % fällig am 21.10.2026 ^ | 40 | 12 | 0,00 |
| 11,950 % fällig am 05.08.2031 ^ | 400 | 116 | 0,01 |
| 12,750 % fällig am 23.08.2022 ^ | 180 | 52 | 0,00 |
| | | 33.597 | 3,12 |

| Beschreibung | AKTIEN | MARKTWERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| **AT&T, Inc.** | 113.222 | 3.794 | 0,35 |
| **Bezeq The Israeli Telecommunication Corp. Ltd.** | 248.312 | 188 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| BT Group PLC | 216.662 | $ 543 | 0,05 |
| CenturyLink, Inc. | 72.468 | 852 | 0,08 |
| Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (d) | 317.708 | 1.500 | 0,14 |
| Corus Entertainment, Inc. 'B' | 9.078 | 43 | 0,00 |
| Eutelsat Communications S.A. | 2.704 | 51 | 0,01 |
| Frontier Communications Corp. (d) | 67.176 | 118 | 0,01 |
| Fuji Media Holdings, Inc. | 6.100 | 85 | 0,01 |
| Gree, Inc. | 11.600 | 54 | 0,01 |
| iHeartMedia, Inc. (d) | 114.628 | 1.725 | 0,16 |
| iHeartMedia, Inc. 'A' (d) | 17.600 | 265 | 0,03 |
| iHeartMedia, Inc. 'B' (d) | 237 | 4 | 0,00 |
| Inmarsat PLC | 6.664 | 46 | 0,00 |
| Koninklijke KPN NV | 148.522 | 457 | 0,04 |
| Lagardere S.C.A. | 20.030 | 523 | 0,05 |
| Millicom International Cellular S.A. | 1.510 | 85 | 0,01 |
| Nippon Telegraph & Telephone Corp. | 42.300 | 1.972 | 0,18 |
| NTT DOCOMO, Inc. | 8.900 | 208 | 0,02 |
| Omnicom Group, Inc. | 1.697 | 139 | 0,01 |
| Orange S.A. | 111.984 | 1.769 | 0,16 |
| PCCW Ltd. | 88.000 | 51 | 0,01 |
| ProSiebenSat.1 Media SE | 8.250 | 129 | 0,01 |
| Proximus SADP | 11.857 | 351 | 0,03 |
| RTL Group S.A. | 1.980 | 101 | 0,01 |
| SES S.A. | 11.033 | 173 | 0,02 |
| Shaw Communications, Inc. 'B' | 7.007 | 143 | 0,01 |
| Swisscom AG | 652 | 328 | 0,03 |
| Tele2 AB 'B' | 8.594 | 126 | 0,01 |
| Telefonica S.A. | 297.024 | 2.446 | 0,23 |
| Telenor ASA | 17.085 | 363 | 0,03 |
| Telephone & Data Systems, Inc. | 7.091 | 216 | 0,02 |
| Telia Co. AB | 107.702 | 478 | 0,05 |
| Telstra Corp. Ltd. | 425.293 | 1.149 | 0,11 |
| Tribune Media Co. 'A' | 1.771 | 82 | 0,01 |
| VEON Ltd. ADR | 92.672 | 259 | 0,02 |
| Verizon Communications, Inc. | 84.395 | 4.821 | 0,45 |
| Viacom, Inc. 'B' | 47.498 | 1.419 | 0,13 |
| Vivendi S.A. | 16.795 | 462 | 0,04 |
| Vodafone Group PLC | 671.679 | 1.103 | 0,10 |
| | | 28.621 | 2,66 |
| **LUXUSGÜTER** | | | |
| Abercrombie & Fitch Co. 'A' | 20.568 | 330 | 0,03 |
| Aisin Seiki Co. Ltd. | 3.100 | 107 | 0,01 |
| American Eagle Outfitters, Inc. | 4.433 | 75 | 0,01 |
| Aoyama Trading Co. Ltd. | 6.600 | 130 | 0,01 |
| Bayerische Motoren Werke AG | 16.164 | 1.197 | 0,11 |
| Bed Bath & Beyond, Inc. | 62.654 | 728 | 0,07 |
| Berkeley Group Holdings PLC | 2.953 | 140 | 0,01 |
| Bridgestone Corp. | 13.400 | 529 | 0,05 |
| Caesars Entertainment Corp. (d) | 93.142 | 1.101 | 0,10 |
| Ceconomy AG | 17.978 | 110 | 0,01 |
| Cie Generale des Etablissements Michelin S.C.A. | 4.520 | 572 | 0,05 |
| Crown Resorts Ltd. | 25.758 | 225 | 0,02 |
| Daimler AG | 40.672 | 2.272 | 0,21 |
| DCM Holdings Co. Ltd. | 10.300 | 101 | 0,01 |
| Dick's Sporting Goods, Inc. | 4.492 | 155 | 0,01 |
| Dillard's, Inc. 'A' | 4.160 | 259 | 0,02 |
| EDION Corp. | 4.500 | 42 | 0,00 |
| Foot Locker, Inc. | 1.486 | 62 | 0,01 |
| Ford Motor Co. | 112.311 | 1.149 | 0,11 |
| GameStop Corp. 'A' | 38.681 | 212 | 0,02 |
| Gap, Inc. | 17.258 | $ 310 | 0,03 |
| Garmin Ltd. | 3.057 | 244 | 0,02 |
| General Motors Co. | 43.255 | 1.667 | 0,16 |
| Geo Holdings Corp. | 3.000 | 38 | 0,00 |
| GNC Holdings, Inc. 'A' (d) | 47.628 | 71 | 0,01 |
| Goodyear Tire & Rubber Co. | 17.112 | 262 | 0,02 |
| Greene King PLC | 8.396 | 66 | 0,01 |
| Hennes & Mauritz AB 'B' | 9.492 | 169 | 0,02 |
| Honda Motor Co. Ltd. | 55.300 | 1.431 | 0,13 |
| Hugo Boss AG | 747 | 50 | 0,01 |
| InterContinental Hotels Group PLC | 923 | 61 | 0,01 |
| Isuzu Motors Ltd. | 5.100 | 58 | 0,01 |
| Kingfisher PLC | 36.638 | 100 | 0,01 |
| Kohl's Corp. | 15.811 | 752 | 0,07 |
| L Brands, Inc. | 12.790 | 334 | 0,03 |
| Li & Fung Ltd. | 538.000 | 94 | 0,01 |
| Macy's, Inc. | 32.342 | 694 | 0,06 |
| Magna International, Inc. | 3.568 | 178 | 0,02 |
| Marks & Spencer Group PLC | 173.531 | 465 | 0,04 |
| Mattel, Inc. (d) | 24.927 | 279 | 0,03 |
| Mazda Motor Corp. | 43.800 | 454 | 0,04 |
| Next PLC | 4.217 | 296 | 0,03 |
| Nissan Motor Co. Ltd. | 142.700 | 1.023 | 0,10 |
| NOK Corp. | 3.100 | 47 | 0,00 |
| Nordstrom, Inc. | 9.131 | 291 | 0,03 |
| PulteGroup, Inc. | 2.468 | 78 | 0,01 |
| Sega Sammy Holdings, Inc. | 3.200 | 39 | 0,00 |
| Sekisui House Ltd. | 7.700 | 127 | 0,01 |
| Signet Jewelers Ltd. | 5.754 | 103 | 0,01 |
| SJM Holdings Ltd. | 340.000 | 386 | 0,04 |
| Skylark Co. Ltd. | 8.000 | 140 | 0,01 |
| Skyworth Digital Holdings Ltd. | 278.000 | 75 | 0,01 |
| Subaru Corp. | 16.900 | 412 | 0,04 |
| Sumitomo Electric Industries Ltd. | 10.100 | 133 | 0,01 |
| Sumitomo Rubber Industries Ltd. | 7.800 | 90 | 0,01 |
| Swatch Group AG | 114 | 33 | 0,00 |
| Tapestry, Inc. | 1.486 | 47 | 0,00 |
| Target Corp. | 28.191 | 2.442 | 0,23 |
| Toyota Motor Corp. | 41.600 | 2.584 | 0,24 |
| Tupperware Brands Corp. | 4.444 | 84 | 0,01 |
| Visteon Corp. (d) | 3.857 | 226 | 0,02 |
| Wesfarmers Ltd. | 5.650 | 143 | 0,01 |
| Williams-Sonoma, Inc. | 709 | 46 | 0,00 |
| Wyndham Destinations, Inc. | 996 | 44 | 0,00 |
| Yokohama Rubber Co. Ltd. | 2.700 | 50 | 0,00 |
| | | 26.212 | 2,43 |
| **BASISKONSUMGÜTER** | | | |
| Altria Group, Inc. | 5.901 | 279 | 0,03 |
| Archer-Daniels-Midland Co. | 18.421 | 752 | 0,07 |
| Aryzta AG (d) | 41.223 | 47 | 0,00 |
| Bunge Ltd. | 4.906 | 273 | 0,03 |
| Carrefour S.A. | 61.027 | 1.180 | 0,11 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. | 16.289 | 556 | 0,05 |
| Coca-Cola Amatil Ltd. | 25.397 | 182 | 0,02 |
| Coles Group Ltd. (d) | 5.671 | 53 | 0,00 |
| General Mills, Inc. | 6.834 | 359 | 0,03 |
| Heineken Holding NV | 1.956 | 205 | 0,02 |
| Herbalife Nutrition Ltd. (d) | 4.600 | 197 | 0,02 |
| Imperial Brands PLC | 9.122 | 215 | 0,02 |
| Inghams Group Ltd. | 15.061 | 42 | 0,00 |
| J Sainsbury PLC | 160.042 | 399 | 0,04 |
| Japan Tobacco, Inc. | 17.200 | 379 | 0,03 |
| Kirin Holdings Co. Ltd. | 16.500 | 357 | 0,03 |
| Kroger Co. | 70.371 | 1.528 | 0,14 |
| METRO AG | 7.339 | $ 134 | 0,01 |
| Philip Morris International, Inc. | 19.109 | 1.501 | 0,14 |
| Procter & Gamble Co. | 27.058 | 2.967 | 0,28 |
| Seven & i Holdings Co. Ltd. | 18.200 | 617 | 0,06 |
| Suedzucker AG | 3.783 | 64 | 0,01 |
| Tate & Lyle PLC | 17.116 | 161 | 0,01 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 38.783 | 4.285 | 0,40 |
| WM Morrison Supermarkets PLC | 90.327 | 232 | 0,02 |
| Woolworths Group Ltd. | 41.637 | 972 | 0,09 |
| | | 17.936 | 1,66 |
| **ENERGIE** | | | |
| ARC Resources Ltd. | 7.783 | 38 | 0,00 |
| Baker Hughes a GE Co. | 2.305 | 57 | 0,01 |
| BP PLC | 499.442 | 3.487 | 0,32 |
| Chevron Corp. | 25.609 | 3.187 | 0,30 |
| ConocoPhillips | 19.680 | 1.200 | 0,11 |
| Crescent Point Energy Corp. | 159.032 | 527 | 0,05 |
| CVR Energy, Inc. | 1.146 | 57 | 0,01 |
| Diamond Offshore Drilling, Inc. (d) | 22.802 | 202 | 0,02 |
| Drilling Co. of 1972 A/S (d) | 356 | 28 | 0,00 |
| Eni SpA | 126.416 | 2.105 | 0,19 |
| Equinor ASA | 54.830 | 1.088 | 0,10 |
| Exxon Mobil Corp. | 75.088 | 5.754 | 0,53 |
| Helmerich & Payne, Inc. | 1.183 | 60 | 0,01 |
| Hess Corp. | 9.477 | 602 | 0,06 |
| HollyFrontier Corp. | 6.606 | 306 | 0,03 |
| Husky Energy, Inc. | 22.025 | 209 | 0,02 |
| Inpex Corp. | 50.800 | 461 | 0,04 |
| Japan Petroleum Exploration Co. Ltd. | 2.300 | 54 | 0,01 |
| Marathon Oil Corp. | 21.738 | 309 | 0,03 |
| Marathon Petroleum Corp. | 13.314 | 744 | 0,07 |
| Murphy Oil Corp. | 15.349 | 378 | 0,03 |
| National Oilwell Varco, Inc. | 8.717 | 194 | 0,02 |
| Noble Corp. PLC (d) | 25.771 | 48 | 0,00 |
| Occidental Petroleum Corp. | 3.173 | 160 | 0,01 |
| Oceaneering International, Inc. (d) | 7.951 | 162 | 0,01 |
| OMV AG | 4.696 | 229 | 0,02 |
| Petrofac Ltd. | 5.373 | 29 | 0,00 |
| Peyto Exploration & Development Corp. | 9.611 | 29 | 0,00 |
| Phillips 66 | 2.245 | 210 | 0,02 |
| Royal Dutch Shell PLC 'A' | 111.702 | 3.654 | 0,34 |
| Total S.A. | 26.117 | 1.467 | 0,14 |
| Transocean Ltd. | 75.037 | 481 | 0,04 |
| Valero Energy Corp. | 13.776 | 1.179 | 0,11 |
| Williams Cos., Inc. | 6.047 | 170 | 0,02 |
| Woodside Petroleum Ltd. | 19.486 | 500 | 0,05 |
| WorleyParsons Ltd. | 8.005 | 83 | 0,01 |
| | | 29.448 | 2,73 |
| **FINANZEN** | | | |
| Aareal Bank AG | 2.755 | 73 | 0,01 |
| Aegon NV | 78.003 | 388 | 0,04 |
| Aflac, Inc. | 12.492 | 685 | 0,06 |
| Ageas | 12.016 | 626 | 0,06 |
| Ally Financial, Inc. | 55.686 | 1.726 | 0,16 |
| American Express Co. | 13.624 | 1.682 | 0,16 |
| American International Group, Inc. | 90.190 | 4.805 | 0,45 |
| AMP Ltd. | 198.229 | 296 | 0,03 |
| ASR Nederland NV | 3.488 | 142 | 0,01 |
| Assicurazioni Generali SpA | 26.685 | 503 | 0,05 |
| Assurant, Inc. | 2.194 | 233 | 0,02 |

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

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| Assured Guaranty Ltd. | 2.816 | $ 119 | 0,01 |
| Australia & New Zealand Banking Group Ltd. | 80.153 | 1.590 | 0,15 |
| AXA S.A. | 49.363 | 1.298 | 0,12 |
| Axis Capital Holdings Ltd. | 863 | 51 | 0,00 |
| Baloise Holding AG | 715 | 127 | 0,01 |
| Banco Santander S.A. | 693.421 | 3.219 | 0,30 |
| Bank of Montreal | 7.946 | 602 | 0,06 |
| BNP Paribas S.A. | 29.580 | 1.404 | 0,13 |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | 11.214 | 884 | 0,08 |
| Capital One Financial Corp. | 20.010 | 1.816 | 0,17 |
| CNO Financial Group, Inc. | 12.175 | 203 | 0,02 |
| Concordia Financial Group Ltd. | 16.500 | 62 | 0,01 |
| Daiwa Securities Group, Inc. | 53.600 | 235 | 0,02 |
| Deutsche Pfandbriefbank AG | 7.727 | 93 | 0,01 |
| Direct Line Insurance Group PLC | 92.579 | 391 | 0,04 |
| Discover Financial Services | 15.902 | 1.234 | 0,11 |
| DNB ASA | 7.970 | 149 | 0,01 |
| Eurobank Ergasias S.A. (d) | 712.189 | 702 | 0,06 |
| Fifth Third Bancorp | 15.349 | 428 | 0,04 |
| Franklin Resources, Inc. | 13.054 | 454 | 0,04 |
| Fukuoka Financial Group, Inc. | 2.100 | 38 | 0,00 |
| Genworth Mortgage Insurance Australia Ltd. | 31.212 | 62 | 0,01 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 984 | 201 | 0,02 |
| Gunma Bank Ltd. | 10.100 | 35 | 0,00 |
| Hokuhoku Financial Group, Inc. | 6.700 | 70 | 0,01 |
| Home Capital Group, Inc. | 5.278 | 78 | 0,01 |
| HSBC Holdings PLC | 475.120 | 3.974 | 0,37 |
| Japan Post Holdings Co. Ltd. | 41.900 | 475 | 0,04 |
| JPMorgan Chase & Co. | 26.579 | 2.972 | 0,27 |
| Legal & General Group PLC | 27.253 | 94 | 0,01 |
| LPL Financial Holdings, Inc. | 701 | 57 | 0,01 |
| Mapfre S.A. | 50.047 | 147 | 0,01 |
| Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. | 399.900 | 1.906 | 0,18 |
| Mizuho Financial Group, Inc. | 1.124.000 | 1.636 | 0,15 |
| MS&AD Insurance Group Holdings, Inc. | 4.300 | 137 | 0,01 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 6.719 | 1.687 | 0,16 |
| National Australia Bank Ltd. | 57.017 | 1.071 | 0,10 |
| National Bank of Canada | 7.419 | 353 | 0,03 |
| Natixis S.A. | 17.069 | 69 | 0,01 |
| Navient Corp. | 49.991 | 682 | 0,06 |
| New York Community Bancorp, Inc. | 24.409 | 244 | 0,02 |
| Nomura Holdings, Inc. | 77.100 | 273 | 0,02 |
| Nordea Bank Abp | 22.803 | 166 | 0,01 |
| ORIX Corp. | 33.900 | 507 | 0,05 |
| PNC Financial Services Group, Inc. | 2.163 | 297 | 0,03 |
| Poste Italiane SpA | 118.132 | 1.247 | 0,11 |
| Power Corp. of Canada | 19.079 | 412 | 0,04 |
| Power Financial Corp. | 9.218 | 212 | 0,02 |
| Provident Financial PLC | 10.659 | 56 | 0,01 |
| Quilter PLC | 32.065 | 57 | 0,01 |
| Raiffeisen Bank International AG | 4.313 | 101 | 0,01 |
| Resona Holdings, Inc. | 67.700 | 283 | 0,03 |
| Santander Consumer USA Holdings, Inc. | 16.710 | 400 | 0,04 |
| SBI Holdings, Inc. | 3.900 | 97 | 0,01 |
| SCOR SE | 4.080 | 179 | 0,02 |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB 'A' | 25.022 | $ 232 | 0,02 |
| Societe Generale S.A. | 59.521 | 1.505 | 0,14 |
| Standard Chartered PLC | 104.505 | 950 | 0,09 |
| Standard Life Aberdeen PLC | 13.786 | 52 | 0,00 |
| Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. | 39.700 | 1.408 | 0,13 |
| Sumitomo Mitsui Trust Holdings, Inc. | 12.100 | 440 | 0,04 |
| Suncorp Group Ltd. | 64.432 | 610 | 0,06 |
| Svenska Handelsbanken AB 'A' | 15.971 | 158 | 0,01 |
| Swedbank AB 'A' | 15.254 | 230 | 0,02 |
| Swiss Life Holding AG | 1.808 | 897 | 0,08 |
| Swiss Re AG | 15.583 | 1.585 | 0,15 |
| Synchrony Financial | 5.150 | 179 | 0,02 |
| T Rowe Price Group, Inc. | 486 | 53 | 0,00 |
| T&D Holdings, Inc. | 10.500 | 114 | 0,01 |
| Talanx AG | 4.919 | 213 | 0,02 |
| Travelers Cos., Inc. | 12.255 | 1.832 | 0,17 |
| U.S. Bancorp | 11.977 | 628 | 0,06 |
| Unipol Gruppo Finanziario SpA | 60.016 | 293 | 0,03 |
| UnipolSai Assicurazioni SpA | 18.603 | 48 | 0,00 |
| Voya Financial, Inc. | 12.489 | 691 | 0,06 |
| Wells Fargo & Co. | 70.422 | 3.332 | 0,31 |
| Westpac Banking Corp. | 44.745 | 891 | 0,08 |
| Yamaguchi Financial Group, Inc. | 4.300 | 29 | 0,00 |
| Zurich Insurance Group AG | 5.636 | 1.963 | 0,18 |
| | | 64.828 | 6,01 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| Anthem, Inc. | 5.597 | 1.580 | 0,15 |
| Astellas Pharma, Inc. | 42.800 | 610 | 0,06 |
| Bayer AG | 12.934 | 898 | 0,08 |
| Cardinal Health, Inc. | 1.022 | 48 | 0,01 |
| CVS Health Corp. | 38.009 | 2.071 | 0,19 |
| Daiichi Sankyo Co. Ltd. | 14.700 | 772 | 0,07 |
| Getinge AB 'B' | 12.098 | 191 | 0,02 |
| Gilead Sciences, Inc. | 34.501 | 2.331 | 0,22 |
| GlaxoSmithKline PLC | 153.725 | 3.088 | 0,29 |
| HCA Healthcare, Inc. | 12.755 | 1.724 | 0,16 |
| Healius Ltd. | 61.414 | 130 | 0,01 |
| Koninklijke Philips NV | 15.881 | 692 | 0,06 |
| Merck & Co., Inc. | 48.110 | 4.034 | 0,37 |
| Miraca Holdings, Inc. | 5.000 | 114 | 0,01 |
| Nipro Corp. | 3.900 | 43 | 0,00 |
| Pfizer, Inc. | 131.489 | 5.696 | 0,53 |
| Quest Diagnostics, Inc. | 3.035 | 309 | 0,03 |
| Roche Holding AG | 10.072 | 2.836 | 0,26 |
| Sanofi | 39.530 | 3.421 | 0,32 |
| Sonic Healthcare Ltd. | 2.732 | 52 | 0,01 |
| Takeda Pharmaceutical Co. Ltd. | 7.000 | 249 | 0,02 |
| Toho Holdings Co. Ltd. | 1.600 | 36 | 0,00 |
| | | 30.925 | 2,87 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| ABB Ltd. | 9.332 | 187 | 0,02 |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. | 18.242 | 731 | 0,07 |
| AGCO Corp. | 1.477 | 115 | 0,01 |
| Aggreko PLC | 8.473 | 85 | 0,01 |
| Alaska Air Group, Inc. | 1.700 | 109 | 0,01 |
| Alstom S.A. | 1.963 | 91 | 0,01 |
| American Airlines Group, Inc. | 37.208 | 1.213 | 0,11 |
| AP Moller - Maersk A/S 'B' | 194 | 242 | 0,02 |
| Arcosa, Inc. | 1.226 | 46 | 0,00 |
| Asahi Glass Co. Ltd. | 9.100 | $ 315 | 0,03 |
| BAE Systems PLC | 34.469 | 217 | 0,02 |
| Boskalis Westminster | 4.179 | 97 | 0,01 |
| Bouygues S.A. | 15.851 | 588 | 0,06 |
| bpost S.A. | 13.791 | 131 | 0,01 |
| Capita PLC (d) | 55.819 | 75 | 0,01 |
| Caterpillar, Inc. | 1.590 | 217 | 0,02 |
| Cie de Saint-Gobain | 16.534 | 647 | 0,06 |
| Cummins, Inc. | 1.635 | 280 | 0,03 |
| Dai Nippon Printing Co. Ltd. | 16.400 | 351 | 0,03 |
| Deere & Co. | 3.956 | 656 | 0,06 |
| Delta Air Lines, Inc. | 3.804 | 216 | 0,02 |
| Deutsche Lufthansa AG | 38.412 | 660 | 0,06 |
| Deutsche Post AG | 6.236 | 205 | 0,02 |
| Downer EDI Ltd. | 14.548 | 71 | 0,01 |
| easyJet PLC | 6.940 | 84 | 0,01 |
| Eaton Corp. PLC | 2.489 | 207 | 0,02 |
| Emerson Electric Co. | 10.596 | 707 | 0,07 |
| Firstgroup PLC (d) | 39.086 | 49 | 0,00 |
| Fluor Corp. | 5.058 | 170 | 0,02 |
| General Electric Co. | 198.919 | 2.089 | 0,19 |
| Hitachi Zosen Corp. | 22.200 | 82 | 0,01 |
| ITOCHU Corp. | 33.100 | 635 | 0,06 |
| Japan Airlines Co. Ltd. | 11.800 | 377 | 0,04 |
| Kanematsu Corp. | 3.800 | 42 | 0,00 |
| Kawasaki Heavy Industries Ltd. | 7.900 | 186 | 0,02 |
| Keppel Corp. Ltd. | 61.100 | 301 | 0,03 |
| Kingboard Holdings Ltd. | 16.000 | 45 | 0,00 |
| Macquarie Infrastructure Corp. | 1.169 | 47 | 0,00 |
| ManpowerGroup, Inc. | 1.086 | 105 | 0,01 |
| Marubeni Corp. | 78.400 | 521 | 0,05 |
| Mitsubishi Corp. | 24.700 | 653 | 0,06 |
| Mitsubishi Heavy Industries Ltd. | 21.800 | 951 | 0,09 |
| Mitsui & Co. Ltd. | 47.100 | 769 | 0,07 |
| Mitsui E&S Holdings Co. Ltd. | 4.700 | 44 | 0,00 |
| Norfolk Southern Corp. | 2.947 | 587 | 0,05 |
| Obrascon Huarte Lain S.A. | 73.303 | 94 | 0,01 |
| Pitney Bowes, Inc. | 43.469 | 186 | 0,02 |
| Rexel S.A. | 21.628 | 275 | 0,03 |
| Royal Mail PLC | 171.275 | 462 | 0,04 |
| Ryder System, Inc. | 5.083 | 296 | 0,03 |
| Seaspan Corp. | 5.919 | 58 | 0,01 |
| Signify NV | 4.705 | 139 | 0,01 |
| Skanska AB 'B' | 4.997 | 90 | 0,01 |
| Sojitz Corp. | 33.300 | 107 | 0,01 |
| Sumitomo Corp. | 34.500 | 524 | 0,05 |
| Sumitomo Heavy Industries Ltd. | 1.400 | 48 | 0,00 |
| Toppan Printing Co. Ltd. | 13.300 | 202 | 0,02 |
| Toyota Tsusho Corp. | 4.300 | 131 | 0,01 |
| Trinity Industries, Inc. | 2.226 | 46 | 0,00 |
| United Technologies Corp. | 2.785 | 363 | 0,03 |
| West Japan Railway Co. | 1.900 | 154 | 0,01 |
| WestJet Airlines Ltd. | 19.107 | 450 | 0,04 |
| WW Grainger, Inc. | 1.097 | 294 | 0,03 |
| | | 20.115 | 1,87 |
| **INFORMATIONSTECHNOLOGIE** | | | |
| Avnet, Inc. | 9.785 | 443 | 0,04 |
| Booz Allen Hamilton Holding Corp. | 6.947 | 460 | 0,04 |
| Canon, Inc. | 28.000 | 820 | 0,08 |
| Corning, Inc. | 35.885 | 1.192 | 0,11 |
| Fujitsu Ltd. | 14.200 | 993 | 0,09 |
| Hitachi Ltd. | 62.900 | 2.316 | 0,22 |
| Intel Corp. | 15.521 | 743 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| International Business Machines Corp. | 40.638 | $ | 5.604 | 0,52 |
| Jabil, Inc. | 10.492 | | 332 | 0,03 |
| KLA-Tencor Corp. | 2.141 | | 253 | 0,02 |
| Konica Minolta, Inc. | 58.600 | | 571 | 0,05 |
| Mixi, Inc. | 2.300 | | 46 | 0,01 |
| NEC Corp. | 11.800 | | 466 | 0,04 |
| Nippon Electric Glass Co. Ltd. | 1.700 | | 43 | 0,00 |
| Oki Electric Industry Co. Ltd. | 11.400 | | 143 | 0,01 |
| QUALCOMM, Inc. | 11.382 | | 866 | 0,08 |
| Ricoh Co. Ltd. | 81.700 | | 818 | 0,08 |
| Seagate Technology PLC | 27.098 | | 1.277 | 0,12 |
| Seiko Epson Corp. | 4.800 | | 76 | 0,01 |
| Symantec Corp. | 7.941 | | 173 | 0,02 |
| TE Connectivity Ltd. | 2.434 | | 233 | 0,02 |
| Western Union Co. | 21.094 | | 420 | 0,04 |
| Xerox Corp. | 15.895 | | 563 | 0,05 |
| | | | 18.851 | 1,75 |
| **GRUNDSTOFFE** | | | | |
| Amcor PLC (d) | 5.008 | | 58 | 0,01 |
| Asahi Kasei Corp. | 6.800 | | 73 | 0,01 |
| BASF SE | 21.451 | | 1.563 | 0,15 |
| BHP Group Ltd. | 25.877 | | 752 | 0,07 |
| CF Industries Holdings, Inc. | 3.444 | | 161 | 0,02 |
| Daicel Corp. | 4.300 | | 38 | 0,00 |
| DIC Corp. | 2.100 | | 56 | 0,01 |
| Domtar Corp. | 5.302 | | 236 | 0,02 |
| Eastman Chemical Co. | 862 | | 67 | 0,01 |
| Evonik Industries AG | 8.132 | | 237 | 0,02 |
| Fletcher Building Ltd. | 54.730 | | 178 | 0,02 |
| Fortescue Metals Group Ltd. | 31.098 | | 198 | 0,02 |
| International Paper Co. | 9.800 | | 424 | 0,04 |
| Israel Chemicals Ltd. | 64.504 | | 340 | 0,03 |
| Israel Corp. Ltd. (d) | 158 | | 38 | 0,00 |
| K+S AG | 10.254 | | 191 | 0,02 |
| Kobe Steel Ltd. | 33.100 | | 217 | 0,02 |
| Kuraray Co. Ltd. | 3.700 | | 44 | 0,00 |
| LyondellBasell Industries NV 'A' | 17.370 | | 1.496 | 0,14 |
| Mitsubishi Materials Corp. | 7.000 | | 200 | 0,02 |
| Mosaic Co. | 28.001 | | 701 | 0,07 |
| Navigator Co. S.A. | 13.463 | | 51 | 0,00 |
| Nippon Paper Industries Co. Ltd. 'L' | 19.500 | | 346 | 0,03 |
| Nippon Steel Corp. | 8.700 | | 150 | 0,01 |
| Oji Holdings Corp. | 26.000 | | 151 | 0,01 |
| Rio Tinto PLC | 5.522 | | 342 | 0,03 |
| Stora Enso Oyj 'R' | 13.461 | | 159 | 0,02 |
| Sumitomo Chemical Co. Ltd. | 33.000 | | 154 | 0,01 |
| Ternium S.A. SP - ADR | 1.788 | | 40 | 0,00 |
| Toyobo Co. Ltd. | 3.600 | | 43 | 0,00 |
| Ube Industries Ltd. | 2.300 | | 48 | 0,00 |
| voestalpine AG | 6.195 | | 192 | 0,02 |
| Yara International ASA | 6.092 | | 296 | 0,03 |
| | | | 9.240 | 0,86 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **IMMOBILIEN** | | | |
| Kerry Properties Ltd. | 56.500 | 237 | 0,02 |
| Nomura Real Estate Holdings, Inc. | 5.300 | 114 | 0,01 |
| Shimao Property Holdings Ltd. | 84.000 | 256 | 0,02 |
| Swire Pacific Ltd. 'A' | 51.000 | 627 | 0,06 |
| Wharf Holdings Ltd. | 16.000 | 43 | 0,01 |
| Wheelock & Co. Ltd. | 28.000 | 201 | 0,02 |
| | | 1.478 | 0,14 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| American Electric Power Co., Inc. | 9.653 | 850 | 0,08 |
| Atco Ltd. 'I' | 9.174 | 310 | 0,03 |
| Capital Power Corp. | 5.111 | 118 | 0,01 |
| CenterPoint Energy, Inc. | 14.116 | 404 | 0,04 |
| Centrica PLC | 568.640 | 635 | 0,06 |
| Chubu Electric Power Co., Inc. | 41.300 | 581 | 0,05 |
| Chugoku Electric Power Co., Inc. | 38.300 | 483 | 0,04 |
| Consolidated Edison, Inc. | 10.743 | 942 | 0,09 |
| Duke Energy Corp. | 7.469 | 659 | 0,06 |
| E.ON SE | 19.366 | 211 | 0,02 |
| EDP - Energias de Portugal S.A. | 198.975 | 757 | 0,07 |
| Electric Power Development Co. Ltd. 'C' | 8.800 | 201 | 0,02 |
| Electricite de France S.A. | 78.962 | 997 | 0,09 |
| Endesa S.A. | 33.006 | 850 | 0,08 |
| Enel SpA | 313.802 | 2.192 | 0,20 |
| Engie S.A. | 34.422 | 523 | 0,05 |
| Entergy Corp. | 10.707 | 1.102 | 0,10 |
| Exelon Corp. | 35.169 | 1.686 | 0,16 |
| Fortum Oyj | 12.167 | 269 | 0,03 |
| Hokuriku Electric Power Co. | 23.300 | 169 | 0,02 |
| Innogy SE | 5.667 | 243 | 0,02 |
| National Grid PLC | 102.090 | 1.088 | 0,10 |
| Osaka Gas Co. Ltd. | 6.300 | 110 | 0,01 |
| Pinnacle West Capital Corp. | 2.281 | 215 | 0,02 |
| PPL Corp. | 16.798 | 521 | 0,05 |
| Public Service Enterprise Group, Inc. | 11.878 | 699 | 0,06 |
| Severn Trent PLC | 1.773 | 46 | 0,00 |
| SSE PLC | 7.370 | 105 | 0,01 |
| Tohoku Electric Power Co., Inc. | 41.700 | 422 | 0,04 |
| Tokyo Gas Co. Ltd. | 6.500 | 153 | 0,01 |
| TransAlta Corp. | 43.714 | 285 | 0,03 |
| United Utilities Group PLC | 5.676 | 57 | 0,01 |
| Vistra Energy Corp. | 18.159 | 411 | 0,04 |
| | | 18.294 | 1,70 |
| | | 265.948 | 24,68 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **RECHTE** | | | | |
| ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A. - Exp. 11.07.2019 | 18.242 | | 29 | 0,00 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | | |
| Nationwide Building Society | | | | |
| 10,250 % | 6.220 | $ | 1.199 | 0,11 |
| Schaeffler AG | 10.385 | | 77 | 0,01 |
| Volkswagen AG | 10.666 | | 1.799 | 0,17 |
| | | | 3.075 | 0,29 |
| **IMMOBILIENFONDS** | | | | |
| Annaly Capital Management, Inc. | 19.537 | | 178 | 0,02 |
| Artis Real Estate Investment Trust | 15.268 | | 136 | 0,01 |
| Cominar Real Estate Investment Trust | 23.716 | | 227 | 0,02 |
| CoreCivic, Inc. | 15.089 | | 313 | 0,03 |
| Dream Office Real Estate Investment Trust | 5.442 | | 99 | 0,01 |
| Hospitality Properties Trust | 7.203 | | 180 | 0,02 |
| Intu Properties PLC | 1.354 | $ | 42 | 0,00 |
| | 114.584 | | 2.526 | 0,24 |
| | | | 3.731 | 0,35 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (k)** | | | | |
| | | | 1.653 | 0,15 |

| | | PARI (000S) | | |
|---|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| Clear Channel Communication, Inc. | | | | |
| 9,000 % fällig am 15.12.2019 | $ | 1.282 | 0 | 0,00 |
| Federal Home Loan Bank | | | | |
| 2,240 % fällig am 14.08.2019 (e)(f) | | 4.300 | 4.289 | 0,40 |
| 2,243 % fällig am 16.08.2019 (e)(f) | | 6.300 | 6.282 | 0,58 |
| 2,254 % fällig am 21.08.2019 (e)(f) | | 12.500 | 12.461 | 1,16 |
| | | | 23.032 | 2,14 |
| **ARGENTINA TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,960 % fällig am 28.02.2020 (e)(f) | ARS | 3.001 | 69 | 0,01 |
| | | | 24.754 | 2,30 |

| | AKTIEN | | |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i) | 7.742.216 | 77.538 | 7,20 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **1.270.759** | **117,93** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 103 | $ (62) | (0,01) |
| Japan Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 4 | (20) | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 307 | (478) | (0,04) |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 1.548 | 4.267 | 0,40 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09/2019 | 276 | (378) | (0,04) |
| | | | | $ 3.329 | 0,31 |

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | $ 112,000 | 23.08.2019 | 255 | $ 2 | $ 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 112,500 | 23.08.2019 | 75 | 1 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 3 | $ 0 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 3.329** | **0,31** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| General Electric Co. | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 300 | $ 17 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.12.2022 | € 1.400 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 18 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-31 5-Year Index | (5,000) % | 20.12.2023 | $ 1.261 | $ (38) | (0,01) |
| CDX.HY-32 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2024 | 2.900 | (24) | 0,00 |
| | | | | $ (62) | (0,01) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-28 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2022 | $ 1.940 | $ 50 | 0,01 |
| CDX.EM-29 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2023 | 1.000 | (1) | 0,00 |
| CDX.EM-30 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2023 | 7.600 | 137 | 0,01 |
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 5.900 | 17 | 0,00 |
| CDX.HY-23 5-Year Index | 5,000 | 20.12.2019 | 1.830 | (70) | (0,01) |
| CDX.HY-25 5-Year Index | 5,000 | 20.12.2020 | 17.670 | (337) | (0,03) |
| CDX.IG-31 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2023 | 2.300 | 39 | 0,00 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 14.600 | 59 | 0,01 |
| | | | | $ (106) | (0,01) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 % | 20.12.2024 | $ 10.900 | $ (680) | (0,06) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 15.200 | (2.142) | (0,20) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 41.600 | (1.093) | (0,10) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2026 | 32.300 | (1.477) | (0,14) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2029 | 18.000 | (424) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 9.600 | (1.686) | (0,15) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,250 | 19.09.2023 | ZAR 86.800 | (48) | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,750 | 19.09.2028 | 78.300 | 52 | 0,01 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,000 | 15.03.2024 | 5.100 | (17) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,250 | 15.03.2024 | 22.800 | (70) | (0,01) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 2,750 % | 17.06.2026 | AUD 460 | $ 28 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,000 | 21.03.2027 | 18.640 | 1.208 | 0,11 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,250 | 17.12.2024 | 1.600 | 65 | 0,01 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 3,500 | 17.06.2025 | 19.492 | 822 | 0,08 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4,250 | 17.12.2024 | 650 | 18 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month AUD-BBR-BBSW | 4,750 | 18.06.2024 | 400 | 7 | 0,00 |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | € 6.200 | (340) | (0,03) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | 2.300 | (151) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2029 | £ 7.900 | (375) | (0,03) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 20.03.2028 | ¥ 1.290.000 | (423) | (0,04) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 21.03.2028 | 230.000 | (83) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,301 | 13.02.2028 | 50.000 | (17) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,351 | 08.02.2028 | 620.000 | (196) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,354 | 18.01.2028 | 210.000 | (68) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,354 | 16.02.2028 | 210.000 | (67) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,380 | 18.06.2028 | 160.000 | (56) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,399 | 18.06.2028 | 30.000 | (10) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,400 | 27.03.2029 | 160.000 | (57) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,415 | 25.03.2029 | 80.000 | (29) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,446 | 18.06.2029 | 140.000 | (59) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 20.03.2029 | 11.081.000 | (4.048) | (0,37) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 29.03.2029 | 160.000 | (58) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,471 | 18.06.2029 | 140.000 | (59) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,095 | 05.02.2021 | MXN 28.800 | 38 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,145 | 02.04.2020 | 900 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,270 | 05.02.2020 | 2.000 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,430 | 17.11.2021 | 2.900 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,610 | 07.07.2021 | 4.200 | 4 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,615 | 21.05.2021 | 12.600 | 12 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,680 | 28.05.2021 | 4.800 | 4 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,780 | 29.09.2022 | 12.930 | 11 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,795 | 02.06.2023 | 3.600 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,798 | 06.09.2021 | 20.000 | 16 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,810 | 02.05.2022 | 1.200 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,850 | 02.05.2022 | 5.300 | 4 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,900 | 20.07.2021 | 24.700 | 18 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,950 | 30.01.2026 | 12.300 | 11 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,980 | 26.08.2024 | 500 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 5,990 | 30.01.2026 | 15.000 | 13 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,080 | 10.03.2026 | 20.700 | 17 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,350 | 01.09.2023 | 3.300 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,490 | 08.09.2026 | 13.700 | 8 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,620 | 18.02.2030 | 600 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,710 | 20.09.2029 | 500 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 6,750 | 31.08.2021 | 7.900 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,150 | 11.06.2027 | 28.100 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,165 | 06.09.2032 | 3.000 | (1) | 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 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,350 | 17.11.2021 | 2.300 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,360 | 21.08.2037 | 3.100 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,370 | 11.10.2027 | 14.800 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,380 | 04.11.2026 | 400 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,380 | 14.08.2037 | 700 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,388 | 17.11.2021 | 1.800 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,480 | 18.06.2037 | 1.300 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,520 | 18.04.2023 | 30.200 | 15 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,530 | 18.04.2023 | 24.900 | 12 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,530 | 21.04.2023 | 3.100 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,538 | 23.02.2022 | 9.800 | (4) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,545 | 18.04.2023 | 19.100 | 9 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,603 | 14.04.2025 | 49.000 | 35 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,610 | 23.01.2023 | 18.100 | 16 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,610 | 15.04.2025 | 3.000 | 2 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,640 | 03.01.2023 | 2.200 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,645 | 03.01.2023 | 4.900 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,670 | 05.03.2025 | 52.900 | 51 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,700 | 02.05.2023 | 7.100 | 7 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,710 | 07.03.2025 | 6.400 | 6 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,715 | 07.03.2025 | 6.300 | 6 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,745 | 05.01.2023 | 3.400 | 3 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,800 | 28.12.2027 | 2.900 | (3) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,805 | 06.02.2023 | 7.800 | 7 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,818 | 17.02.2027 | 11.400 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,820 | 06.02.2023 | 7.900 | 9 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,865 | 27.12.2022 | 5.000 | 5 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,865 | 02.02.2027 | 11.900 | (2) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,875 | 16.12.2022 | 2.800 | 3 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,880 | 27.12.2022 | 79.700 | 40 | 0,01 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,910 | 30.12.2027 | 600 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,984 | 10.12.2027 | 6.800 | (12) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 7,990 | 21.12.2027 | 100 | 0 | 0,00 |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,005 % | 21.12.2027 | MXN 37.500 | $ (47) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,010 | 04.02.2027 | 5.200 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,030 | 31.01.2028 | 4.600 | (9) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,050 | 31.01.2028 | 3.400 | (8) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,090 | 15.01.2027 | 13.000 | (4) | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,103 | 04.01.2038 | 5.600 | (13) | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,120 | 15.01.2027 | 2.700 | (1) | 0,00 |
| | | | | | $ (11.241) | (1,04) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (11.391)** | **(1,06)** |

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

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

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

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag(1) | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 1.300 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.000 | (1) | 0 | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 1.200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 5.200 | (6) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.900 | (3) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 300 | 0 | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 99,000 | 16.10.2019 | 2.200 | (8) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 97,000 | 20.11.2019 | 2.200 | (9) | (5) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 1.600 | (2) | 0 | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 93,000 | 16.10.2019 | 4.500 | (7) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.HY-32 5-Year Index | Verkauf | 94,000 | 16.10.2019 | 3.400 | (6) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 | 21.08.2019 | 8.400 | (8) | (2) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 2.600 | (3) | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 1.000 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.100 | (2) | 0 | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.200 | (1) | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 1.700 | (3) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 3.500 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 3.000 | (4) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 1.800 | (3) | 0 | 0,00 |
| JLN | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.000 | (2) | 0 | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 1.000 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (76) | $ (19) | 0,00 |

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

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

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag(2) | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2020 | $ 50 | $ (4) | $ 4 | $ 0 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 200 | (8) | 9 | 1 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (3) | 3 | 0 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (6) | 5 | (1) | 0,00 |
| BPS | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 1.000 | (22) | 22 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 400 | (6) | 4 | (2) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2019 | 5 | (1) | 1 | 0 | 0,00 |
| BRC | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 | 20.06.2023 | 100 | 1 | (16) | (15) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (6) | 5 | (1) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2019 | 15 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 50 | (4) | 4 | 0 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (6) | 5 | (1) | 0,00 |

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Argentine Republic Government International Bond | 5,000 % | 20.06.2023 | $ 33 | $ 1 | $ (6) | $ (5) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 5.140 | (169) | 154 | (15) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 400 | (13) | 4 | (9) | 0,00 |
| | Colombia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 700 | (7) | 10 | 3 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 2.200 | (38) | 27 | (11) | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 300 | (23) | 25 | 2 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (5) | 4 | (1) | 0,00 |
| DUB | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| GST | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 800 | (26) | 8 | (18) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 1.000 | (21) | 21 | 0 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.06.2021 | 13 | (4) | 4 | 0 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2020 | 900 | (104) | 108 | 4 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 3.920 | (86) | 103 | 17 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 2.400 | (38) | 33 | (5) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (5) | 3 | (2) | 0,00 |
| HUS | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.09.2019 | 7.200 | 11 | 1 | 12 | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | (6) | 3 | (3) | 0,00 |
| | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.300 | (38) | 8 | (30) | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 3.200 | (50) | 51 | 1 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 4.200 | (68) | 48 | (20) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2019 | 175 | (17) | 18 | 1 | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.09.2020 | 20 | (3) | 3 | 0 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 80 | (6) | 7 | 1 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 200 | (6) | 7 | 1 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 140 | (14) | 13 | (1) | 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) | 29 | 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 200 | (3) | 2 | (1) | 0,00 |
| | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.12.2019 | 250 | (22) | 23 | 1 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.12.2020 | 600 | (48) | 52 | 4 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 1.400 | (87) | 67 | (20) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 800 | (44) | 26 | (18) | 0,00 |
| MYC | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2023 | 2.800 | (53) | 60 | 7 | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2022 | 4.600 | (96) | 54 | (42) | (0,01) |
| | Turkey Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.200 | (193) | 41 | (152) | (0,02) |
| | | | | | $ (1.380) | $ 1.062 | $ (318) | (0,03) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 % | 25.05.2046 | $ 707 | $ (140) | $ 89 | $ (51) | 0,00 |
| DUB | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 400 | (7) | 10 | 3 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 | 17.01.2047 | 398 | (18) | 22 | 4 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 2.200 | (138) | 164 | 26 | 0,00 |
| FBF | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 325 | (2) | 2 | 0 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 862 | (13) | 21 | 8 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 | 17.01.2047 | 1.095 | (31) | 43 | 12 | 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) | 136 | 128 | 0,01 |
| | CMBX.NA.AAA.11 Index | 0,500 | 18.11.2054 | 13.800 | (71) | 126 | 55 | 0,01 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 4.021 | 22 | 13 | 35 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.7 Index | 0,500 | 17.01.2047 | 1.991 | (67) | 89 | 22 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 6.400 | (361) | 436 | 75 | 0,01 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 300 | (12) | 15 | 3 | 0,00 |
| MEI | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 500 | (4) | 3 | (1) | 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) | 53 | 6 | 0,00 |
| MYC | ABX.HE.AAA.6-2 Index | 0,110 | 25.05.2046 | 1.033 | (202) | 127 | (75) | (0,01) |
| | CMBX.NA.AAA.12 Index | 0,500 | 17.08.2061 | 500 | (4) | 3 | (1) | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 1.915 | (44) | 61 | 17 | 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 | 675 | 1 | 4 | 5 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 15.500 | 15 | 144 | 159 | 0,02 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.8 Index | 0,500 | 17.10.2057 | 100 | (6) | 7 | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ (1.159) | $ 1.594 | $ 435 | 0,04 |

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

(2) 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 des Strategic Income Fund (Forts.)

## TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeitsdatum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BRC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 100 | 20.12.2019 | $ (1) | $ 2 | $ 1 | 0,00 |
| CBK | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 200 | 20.09.2019 | 0 | 15 | 15 | 0,00 |
| FBF | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 100 | 20.09.2019 | 0 | 8 | 8 | 0,00 |
| GST | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 03-Month USD-LIBOR | 100 | 20.09.2019 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 18.200 | 20.09.2019 | (109) | 923 | 814 | 0,08 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 03-Month USD-LIBOR | 200 | 20.12.2019 | 0 | 1 | 1 | 0,00 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 500 | 20.12.2019 | (3) | 9 | 6 | 0,00 |
| JPM | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 600 | 20.09.2019 | (4) | 29 | 25 | 0,01 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 600 | 20.09.2019 | (3) | 17 | 14 | 0,00 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 300 | 20.12.2019 | (2) | 7 | 5 | 0,00 |
| MYC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 400 | 20.12.2019 | (2) | 15 | 13 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (124) | $ 1.026 | $ 902 | 0,09 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 14.541 | AUD | 20.822 | $ 71 | $ 0 | $ 71 | 0,01 |
| | 08/2019 | AUD | 20.822 | $ | 14.556 | 0 | (72) | (72) | (0,01) |
| BPS | 07/2019 | PEN | 5.266 | | 1.591 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 11.194 | | 1.935 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 665 | ARS | 33.495 | 96 | 0 | 96 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 51.943 | £ | 40.953 | 178 | 0 | 178 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 1.598 | PEN | 5.266 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.935 | TRY | 11.257 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ARS | 53.984 | $ | 1.210 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 40.953 | | 52.022 | 0 | (180) | (180) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ | 846 | RUB | 55.220 | 24 | 0 | 24 | 0,00 |
| | 09/2019 | PEN | 5.266 | $ | 1.593 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | $ | 898 | £ | 709 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 101 | MXN | 1.935 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 7.140 | | 139.845 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 20.822 | $ | 14.415 | 0 | (197) | (197) | (0,02) |
| | 07/2019 | £ | 4.449 | | 5.653 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 1.350.427 | | 12.395 | 0 | (139) | (139) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 58.346 | € | 51.352 | 134 | 0 | 134 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 5.640 | £ | 4.449 | 22 | 0 | 22 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 334 | ZAR | 4.837 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 50.519 | $ | 57.562 | 0 | (117) | (117) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 5.662 | £ | 4.449 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | 09/2019 | PEN | 90 | $ | 27 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 51.057 | | 56.979 | 0 | (1.165) | (1.165) | (0,11) |
| | 07/2019 | £ | 421 | | 536 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 2.711 | RUB | 178.514 | 95 | 0 | 95 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | € | 755 | $ | 859 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | TRY | 34 | | 6 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.009 | ARS | 49.983 | 122 | 0 | 122 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 14.550 | RUB | 965.391 | 727 | 0 | 727 | 0,07 |
| | 08/2019 | PEN | 67 | $ | 20 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | € | 295 | | 334 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 157.100 | | 1.448 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.679 | £ | 1.322 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| MSB | 09/2019 | | 2.133 | INR | 150.782 | 30 | 0 | 30 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | | 516 | BRL | 1.973 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | BRL | 1.973 | $ | 515 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 1.973 | | 489 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 42.563 | | 53.872 | 0 | (298) | (298) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 2.492 | TRY | 14.800 | 65 | 0 | 65 | 0,01 |
| TOR | 08/2019 | | 123 | MXN | 2.370 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | | 14.006 | ¥ | 1.507.527 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 1.507.527 | $ | 14.039 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 08/2019 | NZD | 10.557 | | 6.959 | 0 | (138) | (138) | (0,01) |
| | | | | | | $ 1.631 | $ (2.383) | $ (752) | (0,07) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CAD | 8.743 | $ | 6.481 | $ 0 | $ (209) | $ (209) | (0,02) |
| | 07/2019 | CHF | 5.603 | | 5.586 | 0 | (161) | (161) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 290.758 | | 330.417 | 0 | (698) | (698) | (0,06) |
| | 07/2019 | $ | 4.675 | AUD | 6.694 | 23 | 0 | 23 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 6.647 | CAD | 8.743 | 44 | 0 | 44 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 6.694 | $ | 4.679 | 0 | (23) | (23) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 8.743 | | 6.652 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 331.259 | € | 290.758 | 702 | 0 | 702 | 0,06 |
| | 09/2019 | SGD | 1.287 | $ | 940 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | € | 247.426 | | 281.323 | 0 | (445) | (445) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 6.512 | € | 5.789 | 80 | 0 | 80 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 12.612 | £ | 9.944 | 43 | 0 | 43 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 9.944 | $ | 12.631 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 282.041 | € | 247.426 | 448 | 0 | 448 | 0,04 |
| BRC | 07/2019 | ¥ | 2.064.627 | $ | 18.854 | 0 | (310) | (310) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 4.669 | € | 4.116 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 5.256 | $ | 356 | 0 | (17) | (17) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 6.694 | | 4.634 | 0 | (63) | (63) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 290.758 | | 330.446 | 0 | (669) | (669) | (0,06) |
| | 07/2019 | $ | 5.722 | CHF | 5.603 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 11.348 | € | 10.015 | 57 | 0 | 57 | 0,01 |
| | 07/2019 | ZAR | 2.628 | $ | 176 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 08/2019 | CHF | 5.603 | | 5.739 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 331.289 | € | 290.758 | 672 | 0 | 672 | 0,06 |
| DUB | 09/2019 | INR | 14.360 | $ | 202 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | $ | 310.674 | € | 277.793 | 5.676 | 0 | 5.676 | 0,53 |
| | 09/2019 | HKD | 18.891 | $ | 2.414 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 15.396 | | 17.308 | 0 | (225) | (225) | (0,02) |
| | 07/2019 | £ | 9.944 | | 12.586 | 0 | (70) | (70) | (0,01) |
| | 07/2019 | SEK | 23.714 | | 2.478 | 0 | (78) | (78) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 5.151 | € | 4.549 | 29 | 0 | 29 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.557 | SEK | 23.714 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | SEK | 23.714 | $ | 2.563 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | DKK | 1.002 | | 151 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 298.771 | € | 267.481 | 5.836 | 0 | 5.836 | 0,54 |
| TOR | 07/2019 | | 307.743 | | 275.200 | 5.655 | 0 | 5.655 | 0,52 |
| UAG | 07/2019 | | 19.182 | ¥ | 2.064.627 | 0 | (19) | (19) | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 2.064.627 | $ | 19.227 | 18 | 0 | 18 | 0,00 |
| | | | | | | $ 19.328 | $ (3.135) | $ 16.193 | 1,50 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 16.441** | **1,53** |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **EINLAGENZERTIFIKATE** | | | |
| **Barclays Bank PLC** | | | |
| 2,980 % fällig am 25.10.2019 | $ 1.200 | 1.201 | 0,11 |
| **Summe Einlagenzertifikate** | | **$ 1.201** | **0,11** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 1.280.339** | **118,82** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (202.807)** | **(18,82)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 1.077.532** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(c) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(d) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(e) Nullkuponwertpapier.**

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

**(g) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

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

**(i) Mit dem Fonds verbunden.**

**(j) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**Barmittel in Höhe von USD 8.856 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 2.614 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 1.653 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (1.687) | $ 1.653 | $ 1.653 | 0,15 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.687)** | **$ 1.653** | **$ 1.653** | **0,15** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 218.919 | $ 1.049.852 | $ 1.988 | $ 1.270.759 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.201 | 0 | 1.201 |
| Finanzderivate[3] | 3.329 | 5.050 | 0 | 8.379 |
| **Summen** | **$ 222.248** | **$ 1.056.103** | **$ 1.988** | **$ 1.280.339** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 229.257 | $ 804.356 | $ 2.095 | $ 1.035.708 |
| Einlagen bei Kreditinstituten | 0 | 1.201 | 0 | 1.201 |
| Finanzderivate[3] | 4.506 | (4.453) | 0 | 53 |
| **Summen** | **$ 233.763** | **$ 801.104** | **$ 2.095** | **$ 1.036.962** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

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

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (430) | $ 340 | $ (90) |
| BPS | 189 | (110) | 79 |
| BRC | (308) | 410 | 102 |
| CBK | (329) | 390 | 61 |
| DUB | 29 | (10) | 19 |
| FBF | 29 | 0 | 29 |
| GLM | (1.070) | 950 | (120) |
| GST | 1.133 | (1.190) | (57) |
| HUS | 810 | (630) | 180 |
| MEI | 7 | 0 | 7 |
| MSB | 30 | 0 | 30 |
| MYC | (232) | 64 | (168) |
| MYI | 5.671 | (5.200) | 471 |
| SAL | 164 | 0 | 164 |
| SCX | (602) | 380 | (222) |
| SSB | 5.834 | (5.570) | 264 |
| TOR | 5.655 | (5.340) | 315 |
| UAG | (139) | 0 | (139) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 71,67 | 68,44 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 46,11 | 46,74 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,15 | 0,01 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,31 | 0,50 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,06) | (0,41) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 1,53 | (0,09) |
| Einlagenzertifikate | 0,11 | 0,14 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | 0,00 | (6,29) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | 0,00 | (0,59) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 1,75 | 2,24 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 21,66 | 24,58 |
| Wandelanleihen & Wechsel | 0,02 | 0,02 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,27 | 0,30 |
| US-Regierungsbehörden | 19,28 | 11,09 |
| US-Schatzobligationen | 11,62 | 16,66 |
| Non-Agency-MBS | 9,05 | 8,88 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 16,34 | 20,11 |
| Staatsemissionen | 3,12 | 2,80 |
| Stammaktien | 24,68 | 24,72 |
| Vorzugswertpapiere | 0,29 | 0,32 |
| Real Estate Investment Trusts | 0,35 | 0,35 |
| Kurzfristige Instrumente | 2,30 | 2,86 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 7,20 | 0,26 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,31 | 0,50 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,01) | 0,03 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | (0,01) | (0,07) |
| Zinsswaps | (1,04) | (0,37) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,02) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,03) | (0,12) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,04 | (0,06) |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,09 | (0,05) |
| Devisenterminkontrakte | (0,07) | (0,04) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,50 | 0,20 |
| Einlagenzertifikate | 0,11 | 0,14 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (18,82) | (15,33) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Swissport Financing SARL** | | | | |
| 4,750 % fällig am 08.02.2022 | € | 983 | $ 1.129 | 0,02 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 03.07.2023 | $ | 5.600 | 5.828 | 0,12 |
| 4,450 % fällig am 01.10.2025 | | 14.800 | 15.619 | 0,32 |
| 4,875 % fällig am 16.01.2024 | | 4.600 | 4.943 | 0,10 |
| **AIG Global Funding** | | | | |
| 3,350 % fällig am 25.06.2021 | | 4.000 | 4.071 | 0,08 |
| **Allstate Corp.** | | | | |
| 2,760 % fällig am 29.03.2021 | | 6.500 | 6.514 | 0,13 |
| 2,960 % fällig am 29.03.2023 | | 10.200 | 10.179 | 0,21 |
| **American Campus Communities Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,350 % fällig am 01.10.2020 | | 8.800 | 8.895 | 0,18 |
| 3,750 % fällig am 15.04.2023 | | 1.250 | 1.293 | 0,03 |
| **American Express Co.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.05.2022 | | 54.800 | 55.490 | 1,14 |
| 3,375 % fällig am 17.05.2021 | | 14.800 | 15.084 | 0,31 |
| 3,700 % fällig am 03.08.2023 | | 14.200 | 14.916 | 0,31 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.05.2024 | | 3.500 | 3.603 | 0,07 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 7.000 | 8.587 | 0,18 |
| **AvalonBay Communities, Inc.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.01.2028 | $ | 4.100 | 4.241 | 0,09 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.08.2025 | | 14.200 | 14.799 | 0,30 |
| **B3 S.A. - Brasil Bolsa Balcao** | | | | |
| 5,500 % fällig am 16.07.2020 | | 3.600 | 3.706 | 0,08 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 3,004 % fällig am 20.12.2023 | | 16.418 | 16.729 | 0,34 |
| 3,419 % fällig am 20.12.2028 | | 3.750 | 3.862 | 0,08 |
| 4,100 % fällig am 24.07.2023 | | 3.000 | 3.204 | 0,07 |
| **Bank of Ireland** | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (f)(h) | € | 900 | 1.084 | 0,02 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | |
| 3,552 % fällig am 20.07.2023 | $ | 11.400 | 11.496 | 0,24 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 10,179 % fällig am 12.06.2021 | | 14.900 | 16.870 | 0,35 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 03.09.2023 | € | 1.900 | 2.219 | 0,05 |
| 3,200 % fällig am 10.08.2021 | $ | 600 | 604 | 0,01 |
| 3,684 % fällig am 10.01.2023 | | 1.700 | 1.723 | 0,04 |
| 4,610 % fällig am 15.02.2023 | | 11.800 | 12.215 | 0,25 |
| 4,655 % fällig am 10.08.2021 | | 13.900 | 14.210 | 0,29 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (f)(h) | € | 2.500 | 2.882 | 0,06 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 22.04.2020 | $ | 16.300 | 16.854 | 0,34 |
| **Boston Properties LP** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.01.2025 | | 14.450 | 14.761 | 0,30 |
| **Capital One Financial Corp.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 30.04.2021 | | 5.000 | 5.092 | 0,10 |
| 4,250 % fällig am 30.04.2025 | | 9.800 | 10.510 | 0,22 |
| **Castellum AB** | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | € | 4.500 | 5.431 | 0,11 |
| **Citibank N.A.** | | | | |
| 2,850 % fällig am 12.02.2021 | $ | 2.150 | 2.168 | 0,04 |
| 3,162 % fällig am 23.07.2021 | | 4.950 | 4.965 | 0,10 |
| 3,400 % fällig am 23.07.2021 | | 14.700 | 15.018 | 0,31 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 26.10.2020 | | 5.600 | 5.621 | 0,12 |
| 2,700 % fällig am 30.03.2021 | | 1.150 | 1.156 | 0,02 |
| 2,876 % fällig am 24.07.2023 | | 16.400 | 16.620 | 0,34 |
| 3,950 % fällig am 01.09.2023 | | 11.700 | 11.922 | 0,24 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (f)(h) | € | 700 | 831 | 0,02 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 1,450 % fällig am 14.04.2022 | | 12.200 | 14.108 | 0,29 |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 11.400 | 11.815 | 0,24 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 24.04.2023 | $ | 6.100 | $ 6.336 | 0,13 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 3,676 % fällig am 12.06.2024 | | 13.200 | 13.244 | 0,27 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 16.04.2021 | | 15.400 | 15.646 | 0,32 |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | | 19.470 | 20.348 | 0,42 |
| 3,800 % fällig am 15.09.2022 | | 9.500 | 9.852 | 0,20 |
| 4,891 % fällig am 16.04.2021 | | 12.500 | 12.902 | 0,26 |
| **Daiwa Securities Group, Inc.** | | | | |
| 3,129 % fällig am 19.04.2022 | | 10.600 | 10.755 | 0,22 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 2,700 % fällig am 13.07.2020 | | 18.990 | 18.913 | 0,39 |
| 3,300 % fällig am 16.11.2022 | | 23.400 | 23.019 | 0,47 |
| 4,250 % fällig am 14.10.2021 | | 37.200 | 37.725 | 0,77 |
| **Deutsche Pfandbriefbank AG** | | | | |
| 3,375 % fällig am 22.11.2021 | | 27.600 | 28.380 | 0,58 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 20.09.2022 | | 29.200 | 29.505 | 0,60 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | € | 6.100 | 7.589 | 0,16 |
| **Doric Nimrod Air Finance Alpha Ltd. Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,125 % fällig am 30.11.2024 | $ | 7.012 | 7.307 | 0,15 |
| **Emerald Bay S.A.** | | | | |
| 0,000 % fällig am 08.10.2020 (d) | € | 6.481 | 7.150 | 0,15 |
| **Essex Portfolio LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.04.2026 | $ | 1.000 | 1.023 | 0,02 |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 2,875 % fällig am 13.06.2025 | | 4.540 | 4.791 | 0,10 |
| **Federal Realty Investment Trust** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.07.2027 | | 600 | 613 | 0,01 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 2,597 % fällig am 04.11.2019 | | 12.665 | 12.659 | 0,26 |
| 2,681 % fällig am 09.01.2020 | | 5.500 | 5.497 | 0,11 |
| 3,336 % fällig am 18.03.2021 | | 10.000 | 10.055 | 0,21 |
| 3,753 % fällig am 15.02.2023 | | 12.200 | 11.849 | 0,24 |
| 5,729 % fällig am 07.01.2022 | | 12.200 | 12.585 | 0,26 |
| 8,125 % fällig am 15.01.2020 | | 1.700 | 1.748 | 0,04 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | | |
| 3,105 % fällig am 06.11.2020 | | 15.800 | 15.749 | 0,32 |
| 3,150 % fällig am 15.01.2020 | | 14.300 | 14.330 | 0,29 |
| 3,200 % fällig am 13.07.2020 | | 16.000 | 16.060 | 0,33 |
| 3,527 % fällig am 13.04.2020 | | 200 | 201 | 0,00 |
| 3,700 % fällig am 24.11.2020 | | 2.949 | 2.988 | 0,06 |
| 4,200 % fällig am 01.03.2021 | | 8.697 | 8.893 | 0,18 |
| **GLP Capital LP** | | | | |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | | 2.000 | 2.163 | 0,04 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 23.02.2023 | | 14.600 | 14.952 | 0,31 |
| 3,363 % fällig am 31.10.2022 | | 13.400 | 13.412 | 0,27 |
| 3,610 % fällig am 15.09.2020 | | 10.000 | 10.098 | 0,21 |
| 3,750 % fällig am 22.05.2025 | | 3.500 | 3.664 | 0,07 |
| 3,752 % fällig am 23.04.2020 | | 12.500 | 12.580 | 0,26 |
| **Goodman HK Finance** | | | | |
| 4,375 % fällig am 19.06.2024 | | 5.045 | 5.297 | 0,11 |
| **Goodman U.S. Finance Four LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.10.2037 | | 6.900 | 7.160 | 0,15 |
| **Grupo Aval Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 26.09.2022 | | 17.000 | 17.620 | 0,36 |
| **GSPA Monetization Trust** | | | | |
| 6,422 % fällig am 09.10.2029 | | 13.521 | 15.854 | 0,32 |
| **Hospitality Properties Trust** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.02.2021 | | 4.800 | 4.855 | 0,10 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2026 | | 7.800 | 8.251 | 0,17 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 3,400 % fällig am 08.03.2021 | | 960 | 975 | 0,02 |
| **Indian Railway Finance Corp. Ltd.** | | | | |
| 3,835 % fällig am 13.12.2027 | | 3.300 | 3.362 | 0,07 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.09.2022 (b) | | 11.800 | 11.814 | 0,24 |
| **John Deere Capital Corp.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 07.06.2023 | | 7.800 | 8.175 | 0,17 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 3,012 % fällig am 18.06.2022 | | 13.900 | 13.929 | 0,29 |
| 3,125 % fällig am 23.01.2025 | | 1.624 | 1.671 | 0,03 |
| 3,514 % fällig am 18.06.2022 | | 17.400 | 17.787 | 0,36 |
| 3,900 % fällig am 15.07.2025 | $ | 9.500 | $ 10.152 | 0,21 |
| 4,000 % fällig am 01.03.2021 | | 7.000 | 7.126 | 0,15 |
| **Kookmin Bank** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2029 (h) | | 8.200 | 8.832 | 0,18 |
| **Landesbank Baden-Wuerttemberg** | | | | |
| 2,375 % fällig am 31.05.2022 | | 14.200 | 14.355 | 0,29 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 22.03.2028 | | 1.200 | 1.276 | 0,03 |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (f)(h) | £ | 57.070 | 79.257 | 1,62 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | € | 17.500 | 20.629 | 0,42 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | | 13.000 | 15.803 | 0,32 |
| 3,250 % fällig am 13.11.2028 | | 13.000 | 16.427 | 0,34 |
| **Mid-America Apartments LP** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.06.2027 | $ | 300 | 310 | 0,01 |
| 3,750 % fällig am 15.06.2024 | | 2.061 | 2.146 | 0,04 |
| 4,300 % fällig am 15.10.2023 | | 2.200 | 2.341 | 0,05 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,455 % fällig am 02.03.2023 | | 15.700 | 16.152 | 0,33 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,752 % fällig am 19.07.2023 | AUD | 10.400 | 7.743 | 0,16 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 3,095 % fällig am 10.02.2021 | $ | 19.100 | 19.126 | 0,39 |
| 3,737 % fällig am 24.04.2024 | | 9.000 | 9.388 | 0,19 |
| 3,772 % fällig am 20.01.2022 | | 3.000 | 3.032 | 0,06 |
| 3,875 % fällig am 27.01.2026 | | 9.800 | 10.426 | 0,21 |
| **National Australia Bank Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 20.06.2023 | | 5.000 | 5.231 | 0,11 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 3,766 % fällig am 08.03.2024 | | 7.100 | 7.251 | 0,15 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | |
| 0,555 % fällig am 27.09.2021 | € | 5.800 | 6.642 | 0,14 |
| **Nordea Bank Abp** | | | | |
| 2,250 % fällig am 27.05.2021 | $ | 20.400 | 20.371 | 0,42 |
| **OMX Timber Finance Investments LLC** | | | | |
| 5,420 % fällig am 29.01.2020 | | 7.000 | 7.057 | 0,14 |
| **Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.** | | | | |
| 2,975 % fällig am 17.05.2021 | | 11.900 | 11.909 | 0,24 |
| **Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski S.A. Via PKO Finance AB** | | | | |
| 4,630 % fällig am 26.09.2022 | | 18.900 | 19.954 | 0,41 |
| **Public Storage** | | | | |
| 2,370 % fällig am 15.09.2022 | | 8.700 | 8.755 | 0,18 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 38.900 | 38.995 | 0,80 |
| **RCI Banque S.A.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 11.07.2024 | € | 18.600 | 22.414 | 0,46 |
| **Regions Bank** | | | | |
| 3,374 % fällig am 13.08.2021 | $ | 12.200 | 12.306 | 0,25 |
| **Reliance Standard Life Global Funding** | | | | |
| 3,850 % fällig am 19.09.2023 | | 6.950 | 7.220 | 0,15 |
| **Royal Bank of Canada** | | | | |
| 3,350 % fällig am 22.10.2021 | | 8.600 | 8.847 | 0,18 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 08.01.2021 | | 6.700 | 6.744 | 0,14 |
| **SBA Tower Trust** | | | | |
| 2,877 % fällig am 15.07.2046 | | 10.000 | 10.031 | 0,21 |
| **SMBC Trust Account** | | | | |
| 3,792 % fällig am 09.04.2021 | | 30.000 | 29.859 | 0,61 |
| **Society of Lloyd's** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | £ | 19.600 | 27.606 | 0,56 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.05.2022 | $ | 3.300 | 3.556 | 0,07 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | | 1.800 | 1.975 | 0,04 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | | 1.000 | 1.076 | 0,02 |
| **Stadshypotek AB** | | | | |
| 2,500 % fällig am 05.04.2022 | | 24.800 | 25.053 | 0,51 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 02.07.2027 (b) | € | 1.200 | 1.371 | 0,03 |
| 3,785 % fällig am 21.05.2025 | $ | 7.700 | 7.871 | 0,16 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 4,133 % fällig am 09.03.2021 | | 17.500 | 17.866 | 0,37 |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | |
| 2,400 % fällig am 01.10.2020 | | 13.300 | 13.319 | 0,27 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | £ | 6.296 | 10.480 | 0,21 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 2.246 | 3.781 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Toronto-Dominion Bank** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 15.03.2021 | $ | 1.100 | $ | 1.104 | 0,02 |
| **UBS AG** | | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (h) | | 21.200 | | 22.529 | 0,46 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.04.2021 | | 23.300 | | 23.521 | 0,48 |
| 4,125 % fällig am 15.04.2026 | | 6.100 | | 6.522 | 0,13 |
| **UDR, Inc.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.10.2025 | | 4.500 | | 4.787 | 0,10 |
| **UniCredit SpA** | | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 26.900 | | 30.750 | 0,63 |
| **Unigel Luxembourg S.A.** | | | | | |
| 10,500 % fällig am 22.01.2024 | | 8.900 | | 9.567 | 0,20 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.05.2027 | € | 3.400 | | 4.049 | 0,08 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | | |
| 1,159 % fällig am 01.08.2022 | | 1.300 | | 1.507 | 0,03 |
| 1,250 % fällig am 01.08.2022 | | 15.800 | | 18.457 | 0,38 |
| 1,875 % fällig am 31.01.2024 | | 41.100 | | 49.108 | 1,00 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | | |
| 0,489 % fällig am 15.02.2021 | | 12.900 | | 14.775 | 0,30 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 16.02.2023 | | 2.100 | | 2.433 | 0,05 |
| **Washington Prime Group LP** | | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.08.2024 | $ | 15.000 | | 14.269 | 0,29 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 24.01.2024 | | 11.900 | | 12.519 | 0,26 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | | | |
| 3,325 % fällig am 23.07.2021 | | 14.500 | | 14.641 | 0,30 |
| 3,550 % fällig am 14.08.2023 | | 3.000 | | 3.133 | 0,06 |
| | | | | 1.758.801 | 35,99 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | | |
| **Abbott Ireland Financing DAC** | | | | | |
| 0,000 % fällig am 27.09.2020 (d) | € | 15.900 | | 18.134 | 0,37 |
| **Allergan Funding SCS** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.03.2020 | $ | 14.000 | | 14.044 | 0,29 |
| **Altice France S.A.** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 01.05.2026 | | 500 | | 514 | 0,01 |
| **Altria Group, Inc.** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 05.05.2021 | | 3.300 | | 3.439 | 0,07 |
| **Amgen, Inc.** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 11.05.2022 | | 4.000 | | 4.032 | 0,08 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2019 | | 1.900 | | 1.909 | 0,04 |
| **Arrow Electronics, Inc.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.03.2023 | | 7.300 | | 7.651 | 0,16 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.05.2025 | | 15.300 | | 16.278 | 0,33 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | | |
| 3,222 % fällig am 15.08.2024 | | 6.900 | | 6.950 | 0,14 |
| 3,557 % fällig am 15.08.2027 | | 3.900 | | 3.883 | 0,08 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | | 12.100 | | 12.131 | 0,25 |
| **Baxalta, Inc.** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 23.06.2020 | | 417 | | 418 | 0,01 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | | |
| 3,420 % fällig am 15.12.2023 | | 8.000 | | 7.861 | 0,16 |
| 3,500 % fällig am 25.06.2021 | | 2.000 | | 2.030 | 0,04 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.10.2022 | | 12.200 | | 12.282 | 0,25 |
| 3,625 % fällig am 15.10.2024 | | 10.600 | | 10.660 | 0,22 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | | |
| 4,150 % fällig am 15.03.2028 | | 1.600 | | 1.677 | 0,03 |
| **CenterPoint Energy Resources Corp.** | | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.04.2023 | | 9.000 | | 9.279 | 0,19 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,362 % fällig am 28.05.2021 | | 20.400 | | 20.389 | 0,42 |
| 2,567 % fällig am 02.11.2021 | | 46.600 | | 46.772 | 0,96 |
| 2,978 % fällig am 15.02.2022 | | 27.200 | | 27.135 | 0,55 |
| 3,105 % fällig am 04.08.2020 | | 27.300 | | 27.343 | 0,56 |
| 3,125 % fällig am 02.11.2021 | | 8.750 | | 8.760 | 0,18 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | | |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 10.100 | | 10.617 | 0,22 |
| 4,908 % fällig am 23.07.2025 | | 17.900 | | 19.448 | 0,40 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.05.2024 | $ | 4.800 | $ | 5.095 | 0,10 |
| **CVS Health Corp.** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 09.03.2020 | | 3.000 | | 3.012 | 0,06 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | | |
| 2,300 % fällig am 12.02.2021 | | 25.500 | | 25.410 | 0,52 |
| 3,350 % fällig am 04.05.2021 | | 15.300 | | 15.520 | 0,32 |
| **Dell International LLC** | | | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 15.200 | | 15.668 | 0,32 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 8.600 | | 9.275 | 0,19 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | | |
| 1,950 % fällig am 19.09.2021 | | 12.234 | | 12.110 | 0,25 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 15.06.2020 | | 7.400 | | 7.416 | 0,15 |
| **DXC Technology Co.** | | | | | |
| 3,470 % fällig am 01.03.2021 | | 9.769 | | 9.769 | 0,20 |
| **eBay, Inc.** | | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.07.2022 | | 4.161 | | 4.171 | 0,09 |
| **EMD Finance LLC** | | | | | |
| 2,400 % fällig am 19.03.2020 | | 1.300 | | 1.299 | 0,03 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | | |
| 3,110 % fällig am 15.06.2020 | | 14.200 | | 14.241 | 0,29 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.04.2024 | | 5.300 | | 5.644 | 0,12 |
| **EQM Midstream Partners LP** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.07.2023 | | 8.160 | | 8.491 | 0,17 |
| **Full House Resorts, Inc.** | | | | | |
| 8,575 % fällig am 31.01.2024 | | 2.962 | | 2.919 | 0,06 |
| 9,738 % fällig am 02.02.2024 | | 250 | | 246 | 0,01 |
| **General Electric Co.** | | | | | |
| 3,100 % fällig am 09.01.2023 | | 3.400 | | 3.432 | 0,07 |
| **Kansas City Southern** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 01.06.2026 | | 7.050 | | 6.919 | 0,14 |
| **Keurig Dr Pepper, Inc.** | | | | | |
| 3,551 % fällig am 25.05.2021 | | 14.700 | | 15.022 | 0,31 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.06.2023 | | 16.900 | | 17.719 | 0,36 |
| **Latam Airlines Pass-Through Trust** | | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.08.2029 | | 16.884 | | 17.132 | 0,35 |
| **Marriott International, Inc.** | | | | | |
| 3,103 % fällig am 08.03.2021 | | 9.800 | | 9.830 | 0,20 |
| **MGM Resorts International** | | | | | |
| 5,250 % fällig am 31.03.2020 | | 400 | | 408 | 0,01 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | | | |
| 3,922 % fällig am 01.06.2021 | | 6.200 | | 6.314 | 0,13 |
| **Mondelez International Holdings Netherlands BV** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.10.2021 | | 7.700 | | 7.632 | 0,16 |
| **Mondelez International, Inc.** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 07.05.2023 | | 2.700 | | 2.833 | 0,06 |
| **Netflix, Inc.** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.05.2029 | € | 1.700 | | 2.204 | 0,04 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | $ | 11.800 | | 12.209 | 0,25 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.07.2020 | | 4.000 | | 4.019 | 0,08 |
| **Philip Morris International, Inc.** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 17.08.2022 | | 19.500 | | 19.519 | 0,40 |
| **Schaeffler AG** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 26.03.2022 | € | 5.200 | | 6.069 | 0,12 |
| 1,875 % fällig am 26.03.2024 | | 3.000 | | 3.572 | 0,07 |
| **Smithfield Foods, Inc.** | | | | | |
| 2,700 % fällig am 31.01.2020 | $ | 2.500 | | 2.495 | 0,05 |
| **Suntory Holdings Ltd.** | | | | | |
| 2,550 % fällig am 29.09.2019 | | 600 | | 600 | 0,01 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | | |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | | 5.900 | | 5.942 | 0,12 |
| 3,933 % fällig am 23.04.2021 | | 6.100 | | 6.213 | 0,13 |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | | 3.600 | | 3.745 | 0,08 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.04.2024 | | 15.700 | | 14.866 | 0,30 |
| **United Group BV** | | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.07.2022 | € | 5.200 | | 6.071 | 0,12 |
| **United Technologies Corp.** | | | | | |
| 3,350 % fällig am 16.08.2021 | $ | 6.700 | | 6.850 | 0,14 |
| 3,650 % fällig am 16.08.2023 | | 14.700 | | 15.406 | 0,32 |
| **VMware, Inc.** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | $ | 2.000 | $ | 2.017 | 0,04 |
| **Wabtec Corp.** | | | | | |
| 3,710 % fällig am 15.09.2021 | | 300 | | 299 | 0,01 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | | |
| 3,169 % fällig am 19.03.2021 | | 6.062 | | 6.058 | 0,12 |
| | | | | 639.317 | 13,08 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | | | |
| 3,200 % fällig am 01.03.2022 | | 1.910 | | 1.951 | 0,04 |
| 3,270 % fällig am 01.06.2021 | | 17.000 | | 17.090 | 0,35 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 14.800 | | 14.934 | 0,31 |
| 3,616 % fällig am 12.06.2024 | | 14.000 | | 14.186 | 0,29 |
| **Duke Energy Corp.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.04.2024 | | 8.000 | | 8.445 | 0,17 |
| **Entergy Gulf States Louisiana LLC** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.10.2020 | | 3.000 | | 3.045 | 0,06 |
| **ESB Finance DAC** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 11.06.2030 | € | 200 | | 235 | 0,00 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 15.11.2031 | $ | 450 | | 616 | 0,01 |
| **IPALCO Enterprises, Inc.** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.09.2024 | | 5.500 | | 5.698 | 0,12 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** | | | | | |
| 2,300 % fällig am 15.09.2022 | | 7.500 | | 7.520 | 0,15 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | | |
| 2,835 % fällig am 03.09.2019 | | 15.000 | | 15.006 | 0,31 |
| 3,200 % fällig am 25.02.2022 | | 9.900 | | 10.093 | 0,21 |
| 3,241 % fällig am 25.02.2022 | | 12.300 | | 12.374 | 0,25 |
| 4,535 % fällig am 15.06.2067 | | 791 | | 653 | 0,01 |
| **Ohio Power Co.** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.10.2021 | | 4.600 | | 4.914 | 0,10 |
| **Southern Power Co.** | | | | | |
| 2,937 % fällig am 20.12.2020 | | 17.900 | | 17.906 | 0,37 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 300 | | 312 | 0,01 |
| **Telefonica Chile S.A.** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 12.10.2022 | | 19.300 | | 19.976 | 0,41 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | | |
| 3,376 % fällig am 15.02.2025 | | 19.301 | | 20.160 | 0,41 |
| | | | | 175.114 | 3,58 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | | | 2.573.232 | 52,65 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Chicago Transit Authority, Illinois Revenue Bonds, Series 2008** | | | | | |
| 6,300 % fällig am 01.12.2021 | | 130 | | 137 | 0,00 |
| **Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2008** | | | | | |
| 5,630 % fällig am 01.01.2022 | | 3.185 | | 3.255 | 0,07 |
| **Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015** | | | | | |
| 7,750 % fällig am 01.01.2042 | | 901 | | 1.018 | 0,02 |
| **Iowa Tobacco Settlement Authority Revenue Bonds, Series 2005** | | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.06.2023 | | 445 | | 451 | 0,01 |
| **Riverside County, California Redevelopment Successor Agency Tax Allocation Bonds, Series 2010** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 01.10.2030 | | 9.820 | | 10.471 | 0,21 |
| | | | | 15.332 | 0,31 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | | |
| 2,524 % fällig am 25.03.2034 | | 576 | | 571 | 0,01 |
| 2,570 % fällig am 25.12.2036 | | 101 | | 99 | 0,00 |
| 2,757 % fällig am 25.07.2037 | | 590 | | 580 | 0,01 |
| 2,827 % fällig am 25.09.2042 | | 734 | | 727 | 0,02 |
| 2,870 % fällig am 01.09.2027 | | 22.100 | | 22.871 | 0,47 |
| 3,004 % fällig am 25.05.2040 | | 91 | | 92 | 0,00 |
| 3,150 % fällig am 01.08.2027 | | 1.055 | | 1.109 | 0,02 |
| 3,160 % fällig am 01.06.2029 | | 4.800 | | 5.046 | 0,10 |
| 3,304 % fällig am 25.04.2032 | | 33 | | 34 | 0,00 |
| 3,682 % fällig am 01.10.2044 | | 34 | | 34 | 0,00 |
| 3,882 % fällig am 01.10.2040 | | 13 | | 13 | 0,00 |
| 4,117 % fällig am 01.11.2035 | | 40 | | 41 | 0,00 |
| 4,269 % fällig am 01.09.2035 | | 32 | | 34 | 0,00 |
| 4,279 % fällig am 01.12.2034 | | 63 | | 65 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| 4,329 % fällig am 01.07.2035 | $ 63 | $ 66 | 0,00 |
| 4,393 % fällig am 25.05.2035 | 66 | 69 | 0,00 |
| 4,413 % fällig am 01.09.2035 | 61 | 64 | 0,00 |
| 4,510 % fällig am 01.09.2034 | 12 | 12 | 0,00 |
| 4,523 % fällig am 01.06.2035 | 790 | 833 | 0,02 |
| 4,542 % fällig am 01.09.2035 | 43 | 45 | 0,00 |
| 4,584 % fällig am 01.11.2025 | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,603 % fällig am 01.07.2035 | 30 | 32 | 0,00 |
| 4,607 % fällig am 01.05.2038 | 6.991 | 7.340 | 0,15 |
| 4,628 % fällig am 01.09.2039 | 23 | 23 | 0,00 |
| 4,743 % fällig am 01.11.2034 | 73 | 78 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 01.03.2036 | 14 | 14 | 0,00 |
| 4,755 % fällig am 01.05.2037 | 277 | 295 | 0,01 |
| 4,859 % fällig am 01.04.2033 | 16 | 17 | 0,00 |
| 4,863 % fällig am 01.03.2036 | 13 | 13 | 0,00 |
| 4,893 % fällig am 01.01.2036 | 11 | 11 | 0,00 |
| 5,000 % fällig am 25.04.2033 - 25.06.2043 | 349 | 383 | 0,01 |
| 5,100 % fällig am 01.09.2034 | 482 | 511 | 0,01 |
| 5,349 % fällig am 25.12.2042 | 97 | 105 | 0,00 |
| 5,900 % fällig am 25.07.2042 | 56 | 63 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.02.2021 - 01.03.2029 | 163 | 167 | 0,00 |
| 3,500 % fällig am 01.07.2046 - 01.04.2048 | 12.613 | 12.986 | 0,27 |
| 4,000 % fällig am 01.09.2023 - 01.12.2048 | 136.379 | 141.167 | 2,89 |
| 4,500 % fällig am 01.09.2019 - 01.11.2048 | 23.154 | 24.549 | 0,50 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2021 - 01.04.2039 | 284 | 306 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 01.01.2021 - 01.01.2040 | 7.349 | 8.007 | 0,16 |
| 6,000 % fällig am 01.05.2024 - 01.02.2041 | 3.206 | 3.598 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 01.04.2022 - 01.03.2037 | 124 | 141 | 0,00 |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2034 - 01.09.2049 | 615.800 | 621.091 | 12,71 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2034 - 01.09.2049 | 159.700 | 163.573 | 3,35 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2034 - 01.08.2049 | 97.800 | 101.355 | 2,07 |
| 4,500 % fällig am 01.08.2049 | 8.800 | 9.194 | 0,19 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2049 | 500 | 533 | 0,01 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 1,376 % fällig am 25.08.2022 (a) | 48.320 | 1.612 | 0,03 |
| 2,750 % fällig am 15.09.2040 | 1.040 | 1.058 | 0,02 |
| 2,874 % fällig am 15.10.2040 | 361 | 362 | 0,01 |
| 3,488 % fällig am 25.02.2045 | 102 | 102 | 0,00 |
| 3,704 % fällig am 25.10.2044 | 40 | 40 | 0,00 |
| 3,904 % fällig am 25.07.2044 | 240 | 247 | 0,01 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2029 - 01.11.2048 | 13.569 | 14.103 | 0,29 |
| 4,101 % fällig am 01.09.2035 | 56 | 58 | 0,00 |
| 4,375 % fällig am 01.07.2032 | 4 | 5 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 01.04.2029 - 01.05.2039 | 774 | 824 | 0,02 |
| 4,632 % fällig am 01.07.2027 | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,676 % fällig am 01.11.2035 | 52 | 55 | 0,00 |
| 4,770 % fällig am 01.01.2028 | 2 | 2 | 0,00 |
| 4,817 % fällig am 01.09.2028 | 2 | 2 | 0,00 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2023 - 01.06.2039 | 4.405 | 4.871 | 0,10 |
| 5,689 % fällig am 15.03.2044 | 26.340 | 29.660 | 0,61 |
| 6,000 % fällig am 01.10.2027 - 01.05.2040 | 10.193 | 11.500 | 0,24 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2028 | 106 | 119 | 0,00 |
| **Freddie Mac, TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 21.000 | 21.720 | 0,45 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 2,963 % fällig am 20.09.2065 | 2.764 | 2.764 | 0,06 |
| 2,987 % fällig am 20.08.2062 | 2.918 | 2.920 | 0,06 |
| 3,067 % fällig am 20.08.2065 | 30.147 | 30.139 | 0,62 |
| 3,267 % fällig am 20.01.2066 | 16.646 | 16.774 | 0,34 |
| 3,487 % fällig am 20.06.2067 | 5.229 | 5.327 | 0,11 |
| 3,500 % fällig am 20.09.2048 | 2.843 | 2.939 | 0,06 |
| 3,625 % fällig am 20.04.2030 | 11 | 11 | 0,00 |
| 3,750 % fällig am 20.07.2025 - 20.07.2034 | 106 | 110 | 0,00 |
| 3,846 % fällig am 20.11.2067 | $ 9.990 | $ 10.171 | 0,21 |
| 4,000 % fällig am 20.02.2028 - 20.06.2049 | 14.244 | 14.809 | 0,30 |
| 4,000 % fällig am 20.07.2049 (b) | 12.200 | 12.716 | 0,26 |
| 4,125 % fällig am 20.10.2026 - 20.12.2034 | 61 | 64 | 0,00 |
| 4,500 % fällig am 20.06.2048 - 20.04.2049 | 33.605 | 35.129 | 0,72 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2034 - 20.06.2049 | 53.329 | 56.022 | 1,15 |
| 6,000 % fällig am 20.09.2038 - 15.08.2039 | 33 | 36 | 0,00 |
| 8,000 % fällig am 20.05.2031 | 16 | 18 | 0,00 |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2049 | 41.500 | 42.354 | 0,87 |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 124.600 | 128.620 | 2,63 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 314.400 | 325.924 | 6,67 |
| 4,500 % fällig am 01.07.2049 | 109.600 | 114.195 | 2,34 |
| 5,000 % fällig am 01.07.2049 | 132.900 | 138.946 | 2,84 |
| **Small Business Administration** | | | |
| 5,870 % fällig am 01.07.2028 | 30 | 32 | 0,00 |
| 6,220 % fällig am 01.12.2028 | 1.351 | 1.489 | 0,03 |
| | | 2.155.810 | 44,11 |

## US-SCHATZOBLIGATIONEN

| | | | |
|---|---|---|---|
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.11.2039 (i) | 10.100 | 13.433 | 0,28 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (e)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.07.2026 | 57.879 | 57.509 | 1,18 |
| 0,500 % fällig am 15.04.2024 | 35.964 | 36.422 | 0,74 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2024 | 5.804 | 5.906 | 0,12 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 (i) | 18.280 | 18.726 | 0,38 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 (i) | 86.621 | 90.290 | 1,85 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2042 | 7.689 | 7.727 | 0,16 |
| 0,750 % fällig am 15.02.2045 | 6.293 | 6.233 | 0,13 |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 (i) | 137.717 | 145.019 | 2,97 |
| 0,875 % fällig am 15.02.2047 | 7.092 | 7.234 | 0,15 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2046 | 23.292 | 24.433 | 0,50 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2048 | 3.834 | 4.037 | 0,08 |
| 1,000 % fällig am 15.02.2049 | 1.929 | 2.042 | 0,04 |
| 1,375 % fällig am 15.02.2044 | 11.840 | 13.451 | 0,27 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 1,750 % fällig am 30.06.2024 (b) | 16.700 | 16.694 | 0,34 |
| | | 449.156 | 9,19 |

## NON-AGENCY-MBS

| | | | |
|---|---|---|---|
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | |
| 2,764 % fällig am 25.12.2046 | 217 | 207 | 0,00 |
| 4,078 % fällig am 25.02.2044 | 3.340 | 3.323 | 0,07 |
| 4,544 % fällig am 25.02.2045 | 303 | 311 | 0,01 |
| **Ashford Hospitality Trust** | | | |
| 3,394 % fällig am 15.05.2035 | 8.900 | 8.921 | 0,18 |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 4,351 % fällig am 25.06.2034 | 161 | 161 | 0,00 |
| 4,364 % fällig am 20.09.2035 ^ | 2.400 | 2.257 | 0,05 |
| 4,793 % fällig am 25.05.2035 | 3.628 | 3.859 | 0,08 |
| **Banc of America Mortgage Trust** | | | |
| 4,310 % fällig am 25.07.2035 ^ | 719 | 712 | 0,01 |
| 4,689 % fällig am 25.07.2034 | 394 | 412 | 0,01 |
| 4,730 % fällig am 25.03.2035 | 31 | 30 | 0,00 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 2,781 % fällig am 25.11.2030 | 3 | 3 | 0,00 |
| 4,314 % fällig am 25.07.2034 | 10 | 10 | 0,00 |
| 4,329 % fällig am 25.04.2034 | 476 | 481 | 0,01 |
| 4,343 % fällig am 25.04.2034 | 344 | 344 | 0,01 |
| 4,593 % fällig am 25.04.2034 | 169 | 171 | 0,00 |
| 4,673 % fällig am 25.02.2034 | 171 | 178 | 0,00 |
| 4,761 % fällig am 25.01.2034 | 370 | 383 | 0,01 |
| 5,026 % fällig am 25.04.2033 | 54 | 56 | 0,00 |
| 5,233 % fällig am 25.12.2035 | 383 | 397 | 0,01 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 2,564 % fällig am 25.02.2034 | 88 | 90 | 0,00 |
| 2,964 % fällig am 25.01.2035 | 423 | 424 | 0,01 |
| 4,294 % fällig am 25.09.2035 ^ | 718 | 606 | 0,01 |
| 4,625 % fällig am 25.05.2035 | 841 | 856 | 0,02 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,644 % fällig am 25.11.2036 | 1.650 | 1.661 | 0,03 |
| 4,820 % fällig am 25.10.2035 | 89 | 92 | 0,00 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | |
| 4,680 % fällig am 25.09.2035 | $ 2.909 | $ 2.988 | 0,06 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 3,144 % fällig am 10.03.2048 | 10.000 | 10.249 | 0,21 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.02.2036 | 949 | 910 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2036 ^ | 275 | 187 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2036 ^ | 401 | 335 | 0,01 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,604 % fällig am 25.04.2046 | 1.603 | 1.521 | 0,03 |
| 4,078 % fällig am 20.10.2035 | 5.620 | 5.321 | 0,11 |
| 4,280 % fällig am 25.11.2034 | 892 | 901 | 0,02 |
| 4,285 % fällig am 20.02.2035 | 628 | 636 | 0,01 |
| 4,592 % fällig am 20.02.2036 ^ | 175 | 155 | 0,00 |
| 4,750 % fällig am 19.07.2031 | 1 | 1 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | |
| 2,744 % fällig am 25.06.2035 | 265 | 256 | 0,01 |
| 4,946 % fällig am 25.01.2034 ^ | 24 | 23 | 0,00 |
| 6,500 % fällig am 25.11.2034 ^ | 69 | 69 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 4,252 % fällig am 25.06.2033 | 9 | 9 | 0,00 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-through Certificates** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 ^ | 2.536 | 1.332 | 0,03 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Certificates** | | | |
| 3,500 % fällig am 26.04.2038 | 5.404 | 5.447 | 0,11 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,750 % fällig am 25.04.2036 ^ | 1.218 | 942 | 0,02 |
| 6,000 % fällig am 25.05.2036 ^ | 2.701 | 2.333 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 25.04.2037 ^ | 825 | 579 | 0,01 |
| **Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,498 % fällig am 19.07.2044 | 22 | 23 | 0,00 |
| **Dukinfield PLC** | | | |
| 1,806 % fällig am 15.08.2045 | £ 6.543 | 8.351 | 0,17 |
| **Eurohome UK Mortgages PLC** | | | |
| 0,936 % fällig am 15.06.2044 | 4.334 | 5.328 | 0,11 |
| **European Loan Conduit** | | | |
| 0,750 % fällig am 26.10.2028 | € 12.956 | 14.749 | 0,30 |
| **First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust** | | | |
| 4,463 % fällig am 25.10.2034 | $ 269 | 270 | 0,01 |
| **FirstMac Mortgage Funding Trust** | | | |
| 3,212 % fällig am 08.03.2049 | 941 | 939 | 0,02 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,919 % fällig am 25.06.2034 | 118 | 115 | 0,00 |
| 4,086 % fällig am 25.06.2034 | 91 | 91 | 0,00 |
| 4,396 % fällig am 25.01.2036 ^ | 3.331 | 3.387 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 25.09.2035 | 4.336 | 4.469 | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 25.01.2037 ^ | 54 | 65 | 0,00 |
| **HarborView Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,830 % fällig am 19.05.2035 | 355 | 345 | 0,01 |
| **IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 3,902 % fällig am 25.01.2032 | 1 | 1 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,644 % fällig am 25.06.2037 | 2.236 | 2.217 | 0,05 |
| **JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 3,358 % fällig am 15.11.2048 | 23.113 | 23.904 | 0,49 |
| **JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 2,994 % fällig am 15.12.2049 | 12.043 | 12.354 | 0,25 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 3,304 % fällig am 15.06.2035 | 11.300 | 11.314 | 0,23 |
| 3,394 % fällig am 15.06.2032 | 16.981 | 17.025 | 0,35 |
| **JPMorgan Mortgage Trust** | | | |
| 4,536 % fällig am 25.07.2035 | 337 | 347 | 0,01 |
| 5,750 % fällig am 25.01.2036 ^ | 501 | 399 | 0,01 |
| **Landmark Mortgage Securities PLC** | | | |
| 1,107 % fällig am 17.04.2044 | £ 10.727 | 12.797 | 0,26 |
| **MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust** | | | |
| 4,543 % fällig am 25.01.2036 | $ 35 | 35 | 0,00 |
| 4,663 % fällig am 21.11.2034 | 4.834 | 5.047 | 0,10 |
| **MASTR Reperforming Loan Trust** | | | |
| 7,000 % fällig am 25.05.2035 | 813 | 795 | 0,02 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 2,654 % fällig am 25.11.2035 | 643 | 615 | 0,01 |
| 4,357 % fällig am 25.06.2035 | 922 | 933 | 0,02 |
| 4,453 % fällig am 25.02.2035 | 1.608 | 1.632 | 0,03 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Mortgage Equity Conversion Asset Trust** | | | | |
| 2,450 % fällig am 25.05.2042 | $ | 7.483 | $ 6.901 | 0,14 |
| **MortgageIT Trust** | | | | |
| 2,684 % fällig am 25.10.2035 | | 2.725 | 2.721 | 0,06 |
| **Mulcair Securities DAC** | | | | |
| 0,695 % fällig am 24.04.2071 | € | 21.000 | 23.958 | 0,49 |
| **NAAC Reperforming Loan REMIC Trust** | | | | |
| 7,000 % fällig am 25.10.2034 ^ | $ | 823 | 852 | 0,02 |
| 7,500 % fällig am 25.03.2034 ^ | | 915 | 940 | 0,02 |
| **NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates** | | | | |
| 6,500 % fällig am 25.02.2035 ^ | | 3.308 | 3.393 | 0,07 |
| **Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust** | | | | |
| 3,474 % fällig am 25.02.2035 | | 1.327 | 1.335 | 0,03 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.11.2038 | € | 990 | 1.079 | 0,02 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,511 % fällig am 16.09.2059 | AUD | 28.985 | 20.280 | 0,42 |
| **Prime Mortgage Trust** | | | | |
| 2,804 % fällig am 25.02.2034 | $ | 205 | 194 | 0,00 |
| **Provident Funding Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,820 % fällig am 25.08.2033 | | 11 | 12 | 0,00 |
| **Residential Asset Securitization Trust** | | | | |
| 6,000 % fällig am 25.01.2037 ^ | | 2.969 | 1.841 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 894 | 612 | 0,01 |
| **Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust** | | | | |
| 5,101 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 343 | 315 | 0,01 |
| **RESIMAC Bastille Trust** | | | | |
| 3,280 % fällig am 16.12.2059 | | 8.825 | 8.832 | 0,18 |
| **Resloc UK PLC** | | | | |
| 0,946 % fällig am 15.12.2043 | £ | 5.975 | 7.177 | 0,15 |
| **Rochester Financing PLC** | | | | |
| 2,081 % fällig am 18.06.2045 | | 17.541 | 22.446 | 0,46 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,382 % fällig am 25.04.2034 | $ | 4.879 | 4.964 | 0,10 |
| 4,561 % fällig am 25.09.2034 | | 909 | 928 | 0,02 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.09.2047 | | 23.479 | 22.789 | 0,47 |
| 2,640 % fällig am 19.07.2035 | | 573 | 566 | 0,01 |
| 2,684 % fällig am 25.02.2036 ^ | | 1.152 | 1.106 | 0,02 |
| 2,870 % fällig am 19.04.2035 | | 632 | 627 | 0,01 |
| 2,970 % fällig am 19.05.2034 | | 457 | 448 | 0,01 |
| 3,050 % fällig am 19.09.2032 | | 62 | 62 | 0,00 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 7,500 % fällig am 25.10.2036 ^ | | 816 | 703 | 0,01 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates** | | | | |
| 4,413 % fällig am 25.06.2033 | | 12 | 12 | 0,00 |
| **Taurus IT SRL** | | | | |
| 1,188 % fällig am 18.02.2027 | € | 9.459 | 10.758 | 0,22 |
| **Thornburg Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 3,452 % fällig am 25.06.2047 ^ | $ | 4.441 | 4.144 | 0,08 |
| 4,104 % fällig am 25.09.2037 | | 7.690 | 7.869 | 0,16 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 29.000 | 37.049 | 0,76 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,971 % fällig am 15.07.2051 | | 9.986 | 12.781 | 0,26 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,694 % fällig am 25.10.2045 | $ | 8.937 | 8.943 | 0,18 |
| 2,714 % fällig am 25.01.2045 | | 454 | 453 | 0,01 |
| 2,944 % fällig am 25.07.2045 | | 809 | 802 | 0,02 |
| 3,044 % fällig am 25.01.2045 | | 3.952 | 3.971 | 0,08 |
| 3,957 % fällig am 25.02.2037 ^ | | 1.748 | 1.743 | 0,04 |
| 3,982 % fällig am 25.09.2036 ^ | | 23 | 22 | 0,00 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 21.12.2049 (d) | £ | 0 | 1.429 | 0,03 |
| 1,584 % fällig am 21.12.2049 | | 18.921 | 23.923 | 0,49 |
| 2,284 % fällig am 21.12.2049 | | 2.030 | 2.623 | 0,05 |
| 2,784 % fällig am 21.12.2049 | | 1.015 | 1.292 | 0,03 |
| 3,284 % fällig am 21.12.2049 | | 580 | 741 | 0,02 |
| 3,784 % fällig am 21.12.2049 | | 580 | 726 | 0,02 |
| **Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.05.2035 ^ | $ | 1.059 | 893 | 0,02 |
| 4,395 % fällig am 25.02.2031 | | 1 | 1 | 0,00 |
| 6,000 % fällig am 25.11.2035 ^ | | 1.191 | 1.132 | 0,02 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | | |
| 4,991 % fällig am 25.03.2036 | | 1.122 | 1.158 | 0,02 |
| 5,016 % fällig am 25.01.2035 | $ | 1.202 | $ 1.256 | 0,03 |
| 5,074 % fällig am 25.07.2034 | | 82 | 86 | 0,00 |
| | | | 446.574 | 9,14 |

## FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,684 % fällig am 25.04.2036 | | 6.910 | 6.807 | 0,14 |
| **ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.10.2036 | | 308 | 161 | 0,00 |
| **Adagio CLO Ltd.** | | | | |
| 0,660 % fällig am 15.10.2029 | € | 4.400 | 5.029 | 0,10 |
| **Aegis Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,844 % fällig am 25.06.2035 | $ | 3.204 | 3.178 | 0,07 |
| **AmeriCredit Automobile Receivables Trust** | | | | |
| 2,710 % fällig am 19.07.2021 | | 6.349 | 6.353 | 0,13 |
| **Ameriquest Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,794 % fällig am 25.03.2036 | | 3.611 | 3.615 | 0,07 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.01.2036 | | 937 | 940 | 0,02 |
| 2,874 % fällig am 25.01.2036 | | 10.000 | 9.974 | 0,20 |
| 3,334 % fällig am 25.05.2035 | | 7.300 | 7.340 | 0,15 |
| 3,424 % fällig am 25.10.2034 | | 3.700 | 3.743 | 0,08 |
| **Apidos CLO** | | | | |
| 3,572 % fällig am 19.01.2025 | | 1.656 | 1.658 | 0,03 |
| **Arbour CLO DAC** | | | | |
| 0,580 % fällig am 15.03.2029 | € | 7.700 | 8.744 | 0,18 |
| **Asset-Backed Funding Certificates Trust** | | | | |
| 3,104 % fällig am 25.06.2034 | $ | 154 | 154 | 0,00 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 2,834 % fällig am 25.12.2035 | | 3.773 | 3.769 | 0,08 |
| 3,404 % fällig am 25.10.2037 | | 566 | 570 | 0,01 |
| 3,604 % fällig am 25.01.2045 | | 1.091 | 1.095 | 0,02 |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,650 % fällig am 20.10.2028 | € | 2.700 | 3.083 | 0,06 |
| **Capital Auto Receivables Asset Trust** | | | | |
| 2,553 % fällig am 20.10.2020 | $ | 1.889 | 1.889 | 0,04 |
| **Capital One Multi-Asset Execution Trust** | | | | |
| 2,754 % fällig am 15.06.2022 | | 10.600 | 10.604 | 0,22 |
| **Cent CLO Ltd.** | | | | |
| 3,912 % fällig am 29.10.2025 | | 4.762 | 4.765 | 0,10 |
| **CIT Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,780 % fällig am 25.10.2037 | | 9.376 | 9.507 | 0,20 |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.** | | | | |
| 2,984 % fällig am 25.07.2035 | | 3.330 | 3.357 | 0,07 |
| **Commonbond Student Loan Trust** | | | | |
| 3,254 % fällig am 25.05.2041 | | 2.007 | 2.003 | 0,04 |
| **Contego CLO BV** | | | | |
| 0,599 % fällig am 15.11.2026 | € | 1.593 | 1.815 | 0,04 |
| **Cork Street CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,760 % fällig am 27.11.2028 | | 10.000 | 11.466 | 0,24 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 2,624 % fällig am 25.09.2037 ^ | $ | 2.897 | 2.426 | 0,05 |
| 4,763 % fällig am 25.07.2036 | | 8.684 | 8.901 | 0,18 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.** | | | | |
| 3,259 % fällig am 25.08.2034 | | 896 | 891 | 0,02 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC** | | | | |
| 2,787 % fällig am 25.05.2046 | | 2.378 | 2.260 | 0,05 |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | | |
| 2,464 % fällig am 25.11.2036 | | 159 | 99 | 0,00 |
| **Driver Australia Four Trust** | | | | |
| 2,185 % fällig am 21.08.2025 | AUD | 3.689 | 2.590 | 0,05 |
| **EFS Volunteer LLC** | | | | |
| 3,284 % fällig am 26.07.2027 | $ | 611 | 611 | 0,01 |
| **Elm Park CLO DAC** | | | | |
| 0,620 % fällig am 16.04.2029 | € | 19.100 | 21.755 | 0,45 |
| **FBR Securitization Trust** | | | | |
| 3,109 % fällig am 25.11.2035 | $ | 5.933 | 5.785 | 0,12 |
| **First Franklin Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,139 % fällig am 25.09.2035 | | 1.680 | 1.692 | 0,04 |
| 3,214 % fällig am 25.04.2035 | | 1.035 | 1.042 | 0,02 |
| 3,289 % fällig am 25.03.2035 | | 1.320 | 1.331 | 0,03 |
| 3,679 % fällig am 25.07.2034 | | 1.817 | 1.831 | 0,04 |
| **Flexi ABS Trust** | | | | |
| 2,275 % fällig am 23.06.2023 | AUD | 1.400 | 983 | 0,02 |
| **GE-WMC Mortgage Securities Trust** | | | | |
| 2,444 % fällig am 25.08.2036 | $ | 44 | $ 29 | 0,00 |
| **Grosvenor Place CLO BV** | | | | |
| 0,720 % fällig am 30.10.2029 | € | 4.100 | 4.672 | 0,10 |
| **GSAMP Trust** | | | | |
| 3,254 % fällig am 25.02.2047 | $ | 1.634 | 1.640 | 0,03 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 2.500 | 2.847 | 0,06 |
| **Hertz Fleet Lease Funding LP** | | | | |
| 3,230 % fällig am 10.05.2032 | $ | 12.700 | 12.764 | 0,26 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** | | | | |
| 2,764 % fällig am 25.12.2035 | | 11.898 | 11.897 | 0,24 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 2,554 % fällig am 25.01.2037 | | 2.280 | 2.281 | 0,05 |
| **KVK CLO Ltd.** | | | | |
| 3,697 % fällig am 14.01.2028 | | 4.800 | 4.778 | 0,10 |
| **LCM LP** | | | | |
| 3,632 % fällig am 20.10.2027 | | 6.400 | 6.399 | 0,13 |
| **LoanCore Issuer Ltd.** | | | | |
| 3,524 % fällig am 15.05.2028 | | 14.800 | 14.809 | 0,30 |
| **LP Credit Card ABS Master Trust** | | | | |
| 4,053 % fällig am 20.08.2024 | | 15.537 | 15.393 | 0,32 |
| **Massachusetts Educational Financing Authority** | | | | |
| 3,530 % fällig am 25.04.2038 | | 12 | 12 | 0,00 |
| **Meritage Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 3,154 % fällig am 25.11.2035 | | 230 | 237 | 0,01 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | |
| 3,109 % fällig am 25.07.2035 | | 1.586 | 1.591 | 0,03 |
| 3,379 % fällig am 25.04.2035 | | 2.806 | 2.848 | 0,06 |
| **Morgan Stanley Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,109 % fällig am 25.08.2035 | | 260 | 261 | 0,01 |
| **Mountain View CLO Ltd.** | | | | |
| 3,417 % fällig am 13.10.2027 | | 12.000 | 11.956 | 0,25 |
| **Navient Private Education Loan Trust** | | | | |
| 2,744 % fällig am 15.12.2059 | | 4.706 | 4.704 | 0,10 |
| **Navient Private Education Refi Loan Trust** | | | | |
| 3,010 % fällig am 16.06.2042 | | 9.338 | 9.411 | 0,19 |
| **Neuberger Berman CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | | 10.800 | 10.792 | 0,22 |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,584 % fällig am 25.05.2036 | | 148 | 141 | 0,00 |
| 2,914 % fällig am 25.09.2035 | | 5.952 | 5.971 | 0,12 |
| 3,169 % fällig am 25.07.2035 | | 5.797 | 5.828 | 0,12 |
| **Oaktree CLO Ltd.** | | | | |
| 3,812 % fällig am 20.10.2026 | | 12.370 | 12.384 | 0,25 |
| **Octagon Investment Partners Ltd.** | | | | |
| 3,697 % fällig am 15.04.2026 | | 5.101 | 5.103 | 0,10 |
| **OHA Credit Partners Ltd.** | | | | |
| 3,771 % fällig am 20.10.2025 | | 3.821 | 3.823 | 0,08 |
| **OneMain Direct Auto Receivables Trust** | | | | |
| 3,430 % fällig am 16.12.2024 | | 14.300 | 14.507 | 0,30 |
| **Option One Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.01.2036 | | 206 | 207 | 0,00 |
| **Park Place Securities, Inc.** | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.09.2035 | | 8.437 | 8.499 | 0,17 |
| **Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.09.2035 | | 6.453 | 6.487 | 0,13 |
| 2,884 % fällig am 25.08.2035 | | 4.542 | 4.570 | 0,09 |
| **Penarth Master Issuer PLC** | | | | |
| 2,932 % fällig am 18.09.2022 | | 15.800 | 15.799 | 0,32 |
| **Red & Black Auto Germany UG** | | | | |
| 0,124 % fällig am 15.01.2027 | € | 22.086 | 25.262 | 0,52 |
| **Renaissance Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 3,004 % fällig am 25.11.2034 | $ | 177 | 168 | 0,00 |
| **Residential Asset Mortgage Products Trust** | | | | |
| 2,794 % fällig am 25.02.2036 | | 2.109 | 2.115 | 0,04 |
| **Residential Asset Securities Corp. Trust** | | | | |
| 2,744 % fällig am 25.11.2035 | | 4.581 | 4.572 | 0,09 |
| 3,079 % fällig am 25.02.2035 | | 419 | 422 | 0,01 |
| **Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust** | | | | |
| 3,379 % fällig am 25.03.2035 | | 949 | 953 | 0,02 |
| **Silver Arrow Compartment** | | | | |
| 1,073 % fällig am 20.07.2023 | £ | 2.831 | 3.604 | 0,07 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | |
| 2,510 % fällig am 15.09.2026 | $ | 1.056 | 1.054 | 0,02 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 2,670 % fällig am 26.01.2026 | $ | 935 | $ 932 | 0,02 |
| 2,750 % fällig am 25.07.2023 | | 979 | 978 | 0,02 |
| 2,880 % fällig am 15.12.2027 | | 7.972 | 7.980 | 0,16 |
| 3,130 % fällig am 27.04.2026 | | 3.896 | 3.901 | 0,08 |
| **SoFi Consumer Loan Program LLC** | | | | |
| 2,140 % fällig am 25.09.2026 | | 544 | 543 | 0,01 |
| **Specialty Underwriting & Residential Finance Trust** | | | | |
| 3,229 % fällig am 25.05.2035 | | 1.112 | 1.117 | 0,02 |
| **Staniford Street CLO Ltd.** | | | | |
| 3,590 % fällig am 15.06.2025 | | 3.638 | 3.645 | 0,08 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | |
| 2,594 % fällig am 25.03.2036 | | 2.373 | 2.267 | 0,05 |
| **Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,744 % fällig am 25.02.2036 | | 3.610 | 3.621 | 0,07 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,600 % fällig am 04.08.2028 | € | 600 | 683 | 0,01 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | |
| 3,289 % fällig am 25.11.2035 | $ | 3.352 | 3.368 | 0,07 |
| 3,349 % fällig am 25.03.2035 | | 6.200 | 6.257 | 0,13 |
| 3,404 % fällig am 25.10.2034 | | 2.505 | 2.516 | 0,05 |
| **Westlake Automobile Receivables Trust** | | | | |
| 2,980 % fällig am 18.01.2022 | | 6.667 | 6.685 | 0,14 |
| | | | 449.099 | 9,19 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Development Bank of Japan, Inc.** | | | | |
| 0,875 % fällig am 10.10.2025 | € | 6.800 | 8.128 | 0,17 |
| 2,125 % fällig am 01.09.2022 | $ | 16.000 | 16.019 | 0,33 |
| 2,500 % fällig am 18.10.2022 | | 50.000 | 50.686 | 1,04 |
| **Israel Government International Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 17.01.2028 | | 6.000 | 6.346 | 0,13 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 4.000 | $ 1.328 | 0,03 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 77.900 | 26.068 | 0,53 |
| **Province of Ontario** | | | | |
| 3,150 % fällig am 02.06.2022 | CAD | 14.600 | 11.632 | 0,24 |
| **Province of Quebec** | | | | |
| 2,750 % fällig am 25.08.2021 | $ | 2.700 | 2.751 | 0,06 |
| 3,500 % fällig am 01.12.2022 | CAD | 10.100 | 8.183 | 0,17 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | | |
| 54,501 % fällig am 12.04.2025 (a) | ARS | 21.529 | 403 | 0,01 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,375 % fällig am 14.03.2024 | $ | 10.000 | 10.346 | 0,21 |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | | 16.400 | 17.221 | 0,35 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | | |
| 0,000 % fällig am 17.04.2020 (d) | € | 5.600 | 6.412 | 0,13 |
| **Spain Government International Bond** | | | | |
| 0,600 % fällig am 31.10.2029 | | 22.600 | 26.133 | 0,53 |
| 1,400 % fällig am 30.07.2028 | | 3.100 | 3.873 | 0,08 |
| 1,450 % fällig am 30.04.2029 | | 22.700 | 28.489 | 0,58 |
| 1,850 % fällig am 30.07.2035 | | 3.600 | 4.694 | 0,09 |
| 2,700 % fällig am 31.10.2048 | | 1.700 | 2.548 | 0,05 |
| **Tokyo Metropolitan Government** | | | | |
| 2,000 % fällig am 17.05.2021 | $ | 8.300 | 8.274 | 0,17 |
| | | | 239.534 | 4,90 |
| **INVESTMENTFONDS** | | AKTIEN | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (g)** | | 8.820.668 | 89.001 | 1,82 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **WANDELBARE VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| Motors Liquidation Co. | 12.000 | $ 0 | 0,00 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Firstar Realty LLC** | | | |
| 8,875 % fällig am 31.12.2021 (f) | 4.000 | 4.570 | 0,09 |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (g)** | 3.260.360 | 330.894 | 6,77 |
| | **PARI (000S)** | | |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (j)** | | 5.874 | 0,12 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 5.874 | 0,12 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)** | 2.570.424 | 25.743 | 0,53 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | $ 6.785.948 | 138,84 |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 3-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 230 | $ (25) | 0,00 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 2.086 | (1.262) | (0,03) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 153,000 EUR auf Euro-BTP 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 591 | (1) | 0,00 |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 178,000 EUR auf Euro-OAT France Government 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 1.311 | (1) | 0,00 |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 576 | (872) | (0,02) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 886 | 2.241 | 0,05 |
| Euro-Buxl 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 608 | (3.968) | (0,08) |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 2.168 | (8.435) | (0,17) |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 151,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 768 | 0 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 160,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond September 2019 Futures[1] | Long | 08/2019 | 39 | 0 | 0,00 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 7.507 | 11.392 | 0,23 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 9.339 | 18.755 | 0,38 |
| U.S. Treasury 30-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 3.366 | (17.325) | (0,35) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 4.132 | 31.119 | 0,64 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Short | 09/2019 | 419 | (561) | (0,01) |
| | | | | $ 31.057 | 0,64 |

[1] Future-Style-Option.

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Call - Canada Government 10-Year Bond September 2019 Futures | CAD 160,000 | 16.08.2019 | 565 | $ 5 | $ 2 | 0,00 |
| Put - U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | $ 105,000 | 23.08.2019 | 562 | 5 | 1 | 0,00 |
| Put - U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | 110,000 | 23.08.2019 | 563 | 5 | 1 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 106,250 | 23.08.2019 | 1.713 | 15 | 2 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 106,500 | 23.08.2019 | 3.425 | 29 | 3 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 106,750 | 23.08.2019 | 3.200 | 28 | 3 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 110,000 | 23.08.2019 | 1.967 | 17 | 2 | 0,00 |

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | $ 110,500 | 23.08.2019 | 1.523 | $ 13 | $ 2 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 111,000 | 23.08.2019 | 1.137 | 10 | 1 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 194,000 | 23.08.2019 | 2.223 | 19 | 2 | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 30-Year Bond September 2019 Futures | 195,000 | 23.08.2019 | 1.432 | 12 | 1 | 0,00 |
| | | | | $ 158 | $ 20 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 31.077** | **0,64** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Citigroup, Inc. | 1,000 % | 20.12.2020 | $ 13.100 | $ (116) | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.12.2022 | 2.700 | (176) | (0,01) |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 8.300 | 470 | 0,01 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 7.600 | 44 | 0,00 |
| JPMorgan Chase & Co. | 1,000 | 20.12.2020 | 10.000 | (89) | 0,00 |
| Ryder System, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | 1.500 | 33 | 0,00 |
| Tesco PLC | 1,000 | 20.06.2022 | € 6.700 | 268 | 0,01 |
| | | | | $ 434 | 0,01 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-31 5-Year Index | (1,000) % | 20.12.2023 | $ 113.200 | $ (530) | (0,01) |
| CDX.IG-32 5-Year Index | (1,000) | 20.06.2024 | 139.500 | (768) | (0,02) |
| | | | | $ (1.298) | (0,03) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month CAD-Bank Bill | 1,750 % | 16.12.2046 | CAD 5.200 | $ (479) | (0,01) |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,800 | 22.08.2023 | $ 134.700 | 9.776 | 0,20 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 18.12.2029 | € 4.100 | 49 | 0,00 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | 32.700 | 1.795 | 0,04 |
| Zahlung[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,250 | 18.09.2049 | 20.800 | 3.354 | 0,07 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,613 | 04.07.2042 | 10.600 | 2.685 | 0,05 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,622 | 04.07.2042 | 23.300 | 5.962 | 0,12 |
| Zahlung | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,624 | 04.07.2042 | 53.900 | 13.815 | 0,28 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | £ 130.700 | (2.829) | (0,06) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.12.2049 | 24.400 | 455 | 0,01 |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2029 | 8.800 | (418) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 24.700 | (2.536) | (0,05) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 18.03.2026 | ¥ 19.600.000 | (3.635) | (0,07) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 20.03.2028 | 3.540.000 | (1.211) | (0,02) |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,380 | 18.06.2028 | 9.710.000 | 2.845 | 0,06 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,399 | 18.06.2028 | 1.270.000 | (440) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 20.03.2029 | 2.470.000 | (834) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,705 | 31.10.2038 | 1.180.000 | (1.001) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,750 | 20.03.2038 | 8.400.000 | (7.993) | (0,16) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,750 | 20.12.2038 | 5.060.000 | (4.642) | (0,09) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,785 | 12.11.2038 | 600.000 | (558) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,800 | 22.10.2038 | 400.000 | (383) | (0,01) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 1,000 | 21.03.2048 | 820.000 | (1.316) | (0,03) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,075 | 26.08.2020 | MXN 1.733.400 | 1.137 | 0,02 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,683 | 27.11.2020 | 1.053.200 | (690) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,700 | 02.11.2020 | 1.438.600 | 961 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,720 | 13.11.2020 | 250.700 | 179 | 0,00 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,855 | 03.12.2020 | 2.126.300 | (1.726) | (0,04) |
| | | | | | $ 12.322 | 0,25 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ 11.458** | **0,23** |

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

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

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

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

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

**OPTIONSKAUF**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,943 % | 12.12.2019 | 5.200 | $ 250 | $ 10 | 0,00 |

**OPTIONEN AUF WERTPAPIERE**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FAR | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | $ 73,000 | 08.07.2019 | 165.000 | $ 6 | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 72,500 | 06.08.2019 | 120.100 | 5 | 0 | 0,00 |
| SAL | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.08.2049 | 70,000 | 06.08.2019 | 243.200 | 9 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.07.2049 | 73,000 | 08.07.2019 | 142.000 | 6 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 74,500 | 08.07.2019 | 68.000 | 3 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ 29 | $ 0 | 0,00 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 % | 18.09.2019 | 11.200 | $ (19) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 9.700 | (19) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (38) | $ 0 | 0,00 |

**DEVISENOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungskurs | | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC USD versus MXN | MXN | 19,600 | 03.07.2019 | 13.800 | $ (119) | $ (4) | 0,00 |
| GLM | Call - OTC USD versus MXN | | 19,640 | 11.07.2019 | 12.700 | (79) | (23) | 0,00 |
| HUS | Call - OTC USD versus MXN | | 20,300 | 18.07.2019 | 6.800 | (56) | (4) | 0,00 |
| MYI | Call - OTC USD versus MXN | | 19,800 | 10.07.2019 | 12.150 | (102) | (10) | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus MXN | | 19,800 | 01.08.2019 | 12.700 | (102) | (54) | 0,00 |
| | Call - OTC USD versus MXN | | 20,410 | 01.08.2019 | 4.600 | (46) | (6) | 0,00 |
| | | | | | | $ (504) | $ (101) | 0,00 |

**INFLATIONSCAPS**

| Kontrahent | Beschreibung | Anfänglicher Index | Variabler Zinssatz | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Netto-vermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | Floor - OTC CPURNSA | $ 215,949 | Maximal [(1 + 0,000 %)$^{10}$ - (Index Final/Index Initial)] oder 0 | 12.03.2020 | 19.700 | $ (167) | $ 0 | 0,00 |
| | Floor - OTC CPURNSA | 216,687 | Maximal [(1 + 0,000 %)$^{10}$ - (Index Final/Index Initial)] oder 0 | 07.04.2020 | 47.400 | (423) | 0 | 0,00 |
| | Floor - OTC CPURNSA | 217,965 | Maximal [(1 + 0,000 %)$^{10}$ - (Index Final/Index Initial)] oder 0 | 29.09.2020 | 36.200 | (467) | 0 | 0,00 |
| DUB | Floor - OTC CPURNSA | 215,949 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 10.03.2020 | 7.500 | (56) | 0 | 0,00 |
| | Floor - OTC CPURNSA | 218,011 | Maximal [0,000 % - (Index Final/Index Initial - 1)] oder 0 | 13.10.2020 | 40.100 | (393) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (1.506) | $ 0 | 0,00 |

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1 | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 % | 12.12.2019 | 22.800 | $ (249) | $ (3) | 0,00 |

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

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Russia Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 200 | $ (5) | $ 5 | $ 0 | 0,00 |
| BPS | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.03.2020 | 5.600 | (841) | 869 | 28 | 0,00 |
| GST | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.03.2020 | 4.900 | (728) | 753 | 25 | 0,00 |
| | Russia Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 11.700 | (187) | 115 | (72) | 0,00 |
| | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 11.600 | (496) | 138 | (358) | (0,01) |
| HUS | Petrobras Global Finance BV | 1,000 | 20.03.2020 | 7.500 | (1.126) | 1.164 | 38 | 0,00 |
| JPM | South Africa Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 100 | (6) | 4 | (2) | 0,00 |
| | | | | | $ (3.389) | $ 3.048 | $ (341) | (0,01) |

## CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | CDX.MCDX-25 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2020 | $ 1.700 | $ (3) | $ 25 | $ 22 | 0,00 |
| DUB | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 13.800 | (1.387) | 1.529 | 142 | 0,01 |
| GST | CDX.MCDX-25 5-Year Index | 1,000 | 20.12.2020 | 5.300 | (10) | 79 | 69 | 0,00 |
| | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 15.317 | (650) | 783 | 133 | 0,00 |
| MEI | CMBX.NA.AAA.6 Index | 0,500 | 11.05.2063 | 10.913 | (441) | 536 | 95 | 0,00 |
| UAG | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 6.900 | (280) | 351 | 71 | 0,00 |
| | | | | | $ (2.771) | $ 3.303 | $ 532 | 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] 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FBF | Erhalt | IOS.FN.350.13 Index | 7.892.861 | 1-Month USD-LIBOR | $ 27.625 | 12.01.2044 | $ 0 | $ (68) | $ (68) | 0,00 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CAD | 42.792 | $ | 31.908 | $ 0 | $ (838) | $ (838) | (0,02) |
| | 07/2019 | € | 16.352 | | 18.361 | 0 | (261) | (261) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 31.395 | AUD | 44.956 | 153 | 0 | 153 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 50.971 | CAD | 67.702 | 838 | 0 | 838 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 475.485 | € | 418.414 | 1.004 | 0 | 1.004 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 13.068 | £ | 10.411 | 182 | 0 | 182 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 44.956 | $ | 31.428 | 0 | (155) | (155) | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 27.287 | | 20.761 | 0 | (136) | (136) | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 418.414 | | 476.697 | 0 | (1.010) | (1.010) | (0,02) |
| | 09/2019 | $ | 139 | ILS | 496 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | CAD | 11.642 | $ | 8.677 | 0 | (232) | (232) | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 4.099 | | 4.597 | 0 | (71) | (71) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 1.309 | € | 1.168 | 21 | 0 | 21 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.130 | £ | 886 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | RUB | 10.107 | $ | 155 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 22.448 | ¥ | 2.444.300 | 313 | 0 | 313 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 118 | KRW | 140.304 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | CAD | 39.595 | $ | 29.535 | 0 | (766) | (766) | (0,02) |
| | 07/2019 | € | 351.111 | | 392.677 | 0 | (7.168) | (7.168) | (0,15) |
| | 07/2019 | $ | 15.196 | £ | 11.987 | 63 | (3) | 60 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 51.097 | $ | 35.390 | 0 | (468) | (468) | (0,01) |
| | 07/2019 | CAD | 20.636 | | 15.481 | 0 | (311) | (311) | (0,01) |
| | 07/2019 | € | 7.276 | | 8.285 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 170 | | 215 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | SGD | 11 | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4.222 | AUD | 6.141 | 88 | 0 | 88 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 331.244 | £ | 260.883 | 782 | 0 | 782 | 0,02 |
| | 08/2019 | £ | 205.217 | $ | 261.148 | 0 | (438) | (438) | (0,01) |
| | 08/2019 | ¥ | 1.420.300 | | 13.155 | 19 | (90) | (71) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 4.137 | ARS | 214.495 | 664 | 0 | 664 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 1.031 | ¥ | 110.200 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| DUB | 08/2019 | ARS | 292.940 | $ | 6.045 | 0 | (512) | (512) | (0,01) |
| GLM | 07/2019 | CAD | 50.768 | | 38.119 | 0 | (732) | (732) | (0,02) |
| | 07/2019 | € | 2.224 | | 2.519 | 0 | (14) | (14) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 1.197 | | 1.524 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 14.253 | £ | 11.231 | 41 | 0 | 41 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | MXN | 213.593 | $ | 10.978 | $ 0 | $ (63) | $ (63) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 13.122 | MXN | 260.817 | 359 | 0 | 359 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 21.892 | $ | 16.417 | 0 | (336) | (336) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 495 | | 632 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 58.555 | CAD | 78.785 | 1.736 | 0 | 1.736 | 0,04 |
| | 07/2019 | | 2 | CHF | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.196 | € | 1.051 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 15 | £ | 12 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 2.957 | SGD | 4.001 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 729.100 | $ | 6.718 | 0 | (71) | (71) | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | € | 38.520 | | 43.332 | 0 | (535) | (535) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 517 | | 657 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 30.473 | CAD | 40.837 | 778 | 0 | 778 | 0,02 |
| | 07/2019 | | 2.020 | £ | 1.603 | 20 | 0 | 20 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 4.590.600 | $ | 42.199 | 0 | (549) | (549) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 74.088 | ¥ | 7.961.800 | 54 | 0 | 54 | 0,00 |
| | 09/2019 | INR | 8.768 | $ | 124 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 09/2019 | THB | 37.293 | | 1.176 | 0 | (42) | (42) | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | HKD | 150 | | 19 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 32 | € | 28 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 294.622 | $ | 372.902 | 0 | (2.063) | (2.063) | (0,04) |
| SSB | 09/2019 | HKD | 18.136 | | 2.317 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| TOR | 08/2019 | MXN | 40.742 | | 2.106 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | € | 152 | | 173 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 769 | | 111 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | | | $ 7.123 | $ (16.886) | $ (9.763) | (0,20) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional CAD (Hedged) ausschüttend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | CAD | 7.568 | $ | 5.754 | $ 0 | $ (38) | $ (38) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 5.303 | CAD | 7.169 | 183 | 0 | 183 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 5.758 | | 7.568 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 237 | | 320 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | CAD | 7.699 | $ | 5.867 | 0 | (25) | (25) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 5.545 | CAD | 7.475 | 175 | 0 | 175 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 5.757 | | 7.550 | 25 | 0 | 25 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | CAD | 31 | $ | 24 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 5.647 | CAD | 7.610 | 177 | 0 | 177 | 0,00 |
| | | | | | | $ 605 | $ (63) | $ 542 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional CHF (Hedged) thesaurierend, Investor CHF (Hedged) thesaurierend und Class E CHF (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 7.461 | CHF | 7.484 | $ 214 | $ 0 | $ 214 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | CHF | 78 | $ | 80 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | | 7.571 | | 7.731 | 0 | (34) | (34) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 7.236 | CHF | 7.252 | 202 | 0 | 202 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 7.746 | | 7.563 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | CHF | 99 | $ | 102 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 7.491 | CHF | 7.540 | 242 | 0 | 242 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 7.586 | $ | 7.764 | 0 | (16) | (16) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 7.787 | CHF | 7.586 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 399 | | 396 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | | | | | | $ 716 | $ (50) | $ 666 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 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 | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 489.405 | $ | 556.160 | $ 0 | $ (1.175) | $ (1.175) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ | 557.578 | € | 489.405 | 1.182 | 0 | 1.182 | 0,02 |
| BPS | 07/2019 | € | 43.719 | $ | 49.688 | 0 | (99) | (99) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 46.782 | € | 41.041 | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | | 541.567 | | 484.203 | 9.843 | 0 | 9.843 | 0,20 |
| CBK | 07/2019 | € | 496.895 | $ | 564.722 | 0 | (1.142) | (1.142) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 241 | € | 214 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 557.628 | | 489.405 | 1.131 | 0 | 1.131 | 0,02 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | 07/2019 | € 1.323 | $ 1.485 | $ 0 | $ (21) | $ (21) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 520.524 | € 466.423 | 10.639 | 0 | 10.639 | 0,23 |
| MYI | 07/2019 | 541.435 | 484.203 | 9.975 | 0 | 9.975 | 0,20 |
| RBC | 07/2019 | € 430 | $ 488 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | $ 2.781 | € 2.459 | 19 | 0 | 19 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 21.599 | 19.248 | 321 | 0 | 321 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | € 438 | $ 489 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 16.772 | € 14.909 | 206 | 0 | 206 | 0,00 |
| | | | | $ 33.392 | $ (2.448) | $ 30.944 | 0,64 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional GBP (Hedged) thesaurierend, Institutional GBP (Hedged) ausschüttend und Investor 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 | 07/2019 | £ 1.790 | $ 2.267 | $ 0 | $ (11) | $ (11) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 27 | £ 21 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 18.841 | $ 23.893 | 0 | (85) | (85) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 278 | £ 219 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | 22.734 | 17.897 | 79 | 0 | 79 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | £ 17.874 | $ 22.711 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 23.482 | £ 18.531 | 104 | (1) | 103 | 0,00 |
| | 08/2019 | 22.745 | 17.874 | 38 | 0 | 38 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | 909 | 719 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | £ 174 | $ 222 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 480 | £ 379 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | £ 14 | $ 17 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | $ 23.138 | £ 18.281 | 128 | 0 | 128 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 22.593 | 17.878 | 160 | 0 | 160 | 0,01 |
| | | | | $ 519 | $ (135) | $ 384 | 0,01 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional ILS (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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | $ 9 | ILS 33 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 221 | 801 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 231 | 836 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| SOG | 07/2019 | 230 | 836 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | | | | $ 12 | $ 0 | $ 12 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklasse Institutional 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | ¥ 70.746 | $ 656 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 161 | ¥ 17.346 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | 658 | 70.746 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | 573 | 62.773 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | ¥ 1.464 | $ 14 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 593 | ¥ 64.563 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | 592 | 64.563 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 21 | 2.258 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | ¥ 71.234 | $ 662 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 663 | ¥ 71.234 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | | | | $ 25 | $ (2) | $ 23 | 0,00 |

Zum 30. Juni 2019 standen für die Anteilsklassen Institutional SGD (Hedged) thesaurierend, 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | SGD 93 | $ 68 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | 17.840 | 13.174 | 0 | (12) | (12) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 13.034 | SGD 17.980 | 254 | 0 | 254 | 0,01 |
| | 08/2019 | 13.219 | 17.893 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | 12.701 | 17.443 | 192 | 0 | 192 | 0,00 |
| DUB | 07/2019 | 12.693 | 17.471 | 220 | 0 | 220 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | SGD 17.839 | $ 13.175 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 13.214 | SGD 17.882 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | SGD 17.668 | $ 13.022 | 0 | (36) | (36) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 279 | SGD 384 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| | 08/2019 | SGD 3.996 | $ 2.952 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 13.363 | SGD 18.123 | 40 | 0 | 40 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | 12.200 | 16.810 | 225 | 0 | 225 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des Total Return Bond Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| RYL | 08/2019 | $ | 241 | SGD | 326 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | SGD | 17.518 | $ | 12.952 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 649 | SGD | 889 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 12.991 | | 17.563 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | SGD | 63 | $ | 46 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| UAG | 07/2019 | $ | 32 | SGD | 44 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 971 | $ (66) | $ 905 | 0,02 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | | | **$ 23.742** | **0,49** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKTWERT (000S) | % DES NETTOVERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | $ 81.208 | $ (83.937) | (1,72) |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 61.492 | (63.540) | (1,30) |
| 4,500 % fällig am 01.08.2049 | 51.100 | (53.389) | (1,09) |
| **Ginnie Mae, TBA** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.07.2049 | 43.900 | (45.512) | (0,93) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (246.378)** | **(5,04)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 6.605.847** | **135,16** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (1.718.259)** | **(35,16)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 4.887.588** | **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) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Wertpapier per Emissionstermin.

(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.

(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) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 251.280 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 31. Dezember 2019 Barmittel in Höhe von USD 7.815 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 63.693 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 1.070 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.

(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 5.874 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (5.992) | $ 5.874 | $ 5.875 | 0,12 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (5.992)** | **$ 5.874** | **$ 5.875** | **0,12** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 445.638 | $ 6.328.496 | $ 11.814 | $ 6.785.948 |
| Finanzderivate[3] | 31.077 | 35.200 | 0 | 66.277 |
| Leerverkäufe | 0 | (246.378) | 0 | (246.378) |
| **Summen** | **$ 476.715** | **$ 6.117.318** | **$ 11.814** | **$ 6.605.847** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 478.504 | $ 7.176.775 | $ 39.995 | $ 7.695.274 |
| Finanzderivate[3] | (6.692) | 4.111 | 0 | (2.581) |
| Leerverkäufe | 0 | (74.424) | 0 | (74.424) |
| **Summen** | **$ 471.812** | **$ 7.106.462** | **$ 39.995** | **$ 7.618.269** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| GRE | 2,610 % | 30.04.2019 | 22.07.2019 | $ (103.966) | $ (104.434) | (2,14) |
| IND | 2,560 | 09.05.2019 | 07.08.2019 | (75.407) | (75.692) | (1,55) |
| | 2,590 | 31.05.2019 | 12.07.2019 | (13.130) | (13.159) | (0,27) |
| | 2,600 | 06.06.2019 | 18.07.2019 | (50.969) | (51.061) | (1,04) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (244.346)** | **(5,00)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 166 | $ 0 | $ 166 |
| BPS | 288 | (380) | (92) |
| BRC | 1.978 | (1.990) | (12) |
| CBK | 756 | (630) | 126 |
| DUB | (150) | (380) | (530) |
| FBF | (68) | 0 | (68) |
| GLM | 10.441 | (9.850) | 591 |
| GST | (203) | 430 | 227 |
| HUS | 1.554 | (1.260) | 294 |
| JPM | (47) | 200 | 153 |
| MEI | 95 | 0 | 95 |
| MYI | 9.917 | (9.040) | 877 |
| RBC | (2) | 0 | (2) |
| RYL | 19 | 0 | 19 |
| SCX | (1.605) | 440 | (1.165) |
| SOG | 4 | 0 | 4 |
| SSB | 528 | (310) | 218 |
| TOR | 1 | 0 | 1 |
| UAG | 70 | 0 | 70 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 67,77 | 64,96 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 70,95 | 91,46 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,12 | 0,64 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,64 | (0,14) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,23 | 0,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,49 | 0,08 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (5,04) | (1,52) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (5,00) | (6,95) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 0,02 | 0,02 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 52,65 | 55,28 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,31 | 0,44 |
| US-Regierungsbehörden | 44,11 | 61,70 |
| US-Schatzobligationen | 9,19 | 1,93 |
| Non-Agency-MBS | 9,14 | 8,75 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 9,19 | 11,85 |
| Staatsemissionen | 4,90 | 6,34 |
| Investmentfonds | 1,82 | 1,79 |
| Vorzugswertpapiere | 0,09 | 0,09 |
| Börsengehandelte Teilfonds | 6,77 | 6,72 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,12 | 0,89 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,53 | 1,26 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,64 | (0,14) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,01 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,03) | 0,04 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,00 | (0,01) |
| Zinsswaps | 0,25 | (0,02) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,01) | (0,03) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,00 | (0,01) |
| Devisenterminkontrakte | (0,20) | 0,00 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,69 | 0,13 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (5,04) | (1,52) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (35,16) | (55,48) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | |
| **AIA Group Ltd.** | | | |
| 2,907 % fällig am 20.09.2021 | $ 200 | $ 200 | 0,66 |
| **Athene Global Funding** | | | |
| 3,826 % fällig am 01.07.2022 | 500 | 504 | 1,66 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | |
| 3,470 % fällig am 01.06.2021 | 100 | 101 | 0,33 |
| **Banco Santander Chile** | | | |
| 3,380 % fällig am 25.07.2020 | 600 | 602 | 1,98 |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 3,252 % fällig am 21.07.2021 | 500 | 502 | 1,65 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | |
| 3,000 % fällig am 30.03.2020 | 500 | 501 | 1,65 |
| **Brixmor Operating Partnership LP** | | | |
| 3,629 % fällig am 01.02.2022 | 100 | 100 | 0,33 |
| **Citibank N.A.** | | | |
| 3,123 % fällig am 20.05.2022 | 300 | 300 | 0,98 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | |
| 4,891 % fällig am 16.04.2021 | 500 | 516 | 1,69 |
| **Emirates NBD PJSC** | | | |
| 4,132 % fällig am 26.01.2020 | 200 | 202 | 0,66 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 3,363 % fällig am 31.10.2022 | 620 | 621 | 2,04 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | |
| 3,370 % fällig am 25.07.2022 | 600 | 602 | 1,98 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | |
| 3,247 % fällig am 13.07.2022 | 300 | 299 | 0,98 |
| **ORIX Corp.** | | | |
| 2,650 % fällig am 13.04.2021 | 500 | 501 | 1,65 |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | |
| 2,995 % fällig am 24.05.2021 | 300 | 301 | 0,99 |
| **Synchrony Financial** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.08.2019 | 327 | 327 | 1,07 |
| | | 6.179 | 20,30 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| **BAT Capital Corp.** | | | |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | 500 | 501 | 1,65 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | |
| 3,278 % fällig am 14.09.2021 | 500 | 504 | 1,66 |
| 3,521 % fällig am 28.05.2021 | 1.000 | 1.010 | 3,32 |
| **Cigna Corp.** | | | |
| 2,760 % fällig am 17.03.2020 | 600 | 601 | 1,97 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | |
| 3,092 % fällig am 09.10.2020 | $ 500 | $ 499 | 1,64 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | |
| 2,955 % fällig am 04.05.2020 | 650 | 651 | 2,14 |
| **eBay, Inc.** | | | |
| 3,059 % fällig am 01.08.2019 | 145 | 145 | 0,48 |
| **EQT Corp.** | | | |
| 3,089 % fällig am 01.10.2020 | 500 | 500 | 1,64 |
| **GATX Corp.** | | | |
| 3,285 % fällig am 05.11.2021 | 100 | 99 | 0,32 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | |
| 3,115 % fällig am 10.02.2021 | 400 | 399 | 1,31 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | |
| 3,800 % fällig am 26.11.2020 | 200 | 204 | 0,67 |
| **Wabtec Corp.** | | | |
| 3,710 % fällig am 15.09.2021 | 400 | 399 | 1,31 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | |
| 4,600 % fällig am 10.05.2021 | 400 | 412 | 1,35 |
| | | 5.924 | 19,46 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | |
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 3,418 % fällig am 15.02.2023 | 400 | 396 | 1,30 |
| **Duke Energy Corp.** | | | |
| 3,028 % fällig am 14.05.2021 | 500 | 502 | 1,65 |
| **Sempra Energy** | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | 500 | 498 | 1,63 |
| | | 1.396 | 4,58 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | 13.499 | 44,34 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 3,297 % fällig am 20.08.2066 | 880 | 888 | 2,92 |
| 3,309 % fällig am 20.05.2066 | 1.703 | 1.716 | 5,63 |
| 5,342 % fällig am 20.09.2066 | 896 | 983 | 3,23 |
| | | 3.587 | 11,78 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **BX Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 3,144 % fällig am 15.11.2035 | 244 | 244 | 0,80 |
| **BX Trust** | | | |
| 3,274 % fällig am 15.07.2034 | 340 | 340 | 1,12 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | |
| 4,759 % fällig am 25.10.2035 | 11 | 12 | 0,04 |
| | | 596 | 1,96 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **Allegro CLO Ltd.** | | | |
| 3,803 % fällig am 30.01.2026 | $ 357 | $ 357 | 1,17 |
| **Cent CLO Ltd.** | | | |
| 3,912 % fällig am 29.10.2025 | 335 | 336 | 1,10 |
| **EFS Volunteer LLC** | | | |
| 3,430 % fällig am 25.10.2035 | 645 | 642 | 2,11 |
| **Oaktree CLO Ltd.** | | | |
| 3,812 % fällig am 20.10.2026 | 825 | 826 | 2,71 |
| **Towd Point Mortgage Trust** | | | |
| 3,004 % fällig am 25.02.2057 | 574 | 574 | 1,89 |
| **Utah State Board of Regents** | | | |
| 3,154 % fällig am 25.01.2057 | 620 | 620 | 2,04 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | 592 | 595 | 1,96 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | |
| 3,300 % fällig am 25.07.2026 | 198 | 198 | 0,65 |
| | | 4.148 | 13,63 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | |
| 3,522 % fällig am 21.08.2022 | 500 | 500 | 1,64 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (b)** | | | |
| | | 3.674 | 12,07 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 3.674 | 12,07 |
| | **AKTIEN** | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)*** | 307.442 | 3.079 | 10,12 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 29.083** | **95,54** |

* Aufgrund von Marktwertschwankungen lag das Engagement des TRENDS Managed Futures Strategy Fund im PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund am 28. Juni 2019 knapp über 10 %. Ab dem 12. Juli 2019 erfüllte der Fonds die Vorgaben wieder.

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 90-Day Eurodollar September Futures | Long | 09/2021 | 118 | $ 68 | 0,22 |
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 66 | 31 | 0,10 |
| BIST 30 Index August Futures | Short | 08/2019 | 539 | (10) | (0,04) |
| CAC 40 Index July Futures | Long | 07/2019 | 4 | 2 | 0,01 |
| DAX Index September Futures | Long | 09/2019 | 1 | 2 | 0,01 |
| E-mini Russell 2000 Index September Futures | Short | 09/2019 | 2 | (3) | (0,01) |
| E-mini S&P 500 Index September Futures | Long | 09/2019 | 1 | 1 | 0,00 |
| Euro-BTP Italy Government Bond September Futures | Long | 09/2019 | 14 | 80 | 0,26 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 8 | 22 | 0,07 |
| FTSE 100 Index September Futures | Long | 09/2019 | 10 | 6 | 0,02 |
| FTSE China A50 Index July Futures | Long | 07/2019 | 84 | 10 | 0,03 |
| FTSE/JSE Index September Futures | Long | 09/2019 | 20 | (5) | (0,02) |
| MSCI Singapore Index July Futures | Long | 07/2019 | 42 | 6 | 0,02 |
| Nikkei 225 Index September Futures | Short | 09/2019 | 7 | (4) | (0,01) |
| S&P/Toronto Stock Exchange 60 September Futures | Long | 09/2019 | 11 | (14) | (0,04) |
| SPI 200 Index September Futures | Long | 09/2019 | 19 | 17 | 0,06 |
| Topix Index September Futures | Short | 09/2019 | 6 | 0 | 0,00 |
| VSTOXX Mini July Futures | Short | 07/2019 | 168 | 17 | 0,06 |
| WIG20 Index September Futures | Long | 09/2019 | 63 | (2) | (0,01) |
| | | | | $ 224 | 0,73 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 224** | **0,73** |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
(Forts.)

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 8,170 % | 02.01.2023 | BRL | 11.900 | $ 119 | 0,39 |
| Erhalt | 1-Year BRL-CDI | 9,835 | 02.01.2023 | | 8.800 | 225 | 0,74 |
| Zahlung | 1-Year BRL-CDI | 10,730 | 02.01.2023 | | 11.900 | (416) | (1,37) |
| Erhalt | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,250 | 20.06.2028 | CAD | 5.900 | 38 | 0,12 |
| Erhalt | 3-Month PLN-WIBOR | 2,000 | 19.06.2024 | PLN | 2.400 | 0 | 0,00 |
| Zahlung | 3-Month PLN-WIBOR | 2,250 | 20.03.2024 | | 9.700 | (27) | (0,09) |
| Zahlung | 3-Month PLN-WIBOR | 2,500 | 19.09.2023 | | 44.400 | (527) | (1,73) |
| Erhalt | 3-Month PLN-WIBOR | 2,500 | 19.12.2023 | | 58.000 | 680 | 2,23 |
| Erhalt | 3-Month SGD-SOR | 1,918 | 21.03.2023 | SGD | 8.300 | 96 | 0,32 |
| Zahlung | 3-Month SGD-SOR | 2,223 | 19.12.2023 | | 5.810 | (53) | (0,18) |
| Erhalt | 3-Month SGD-SOR | 2,240 | 19.12.2023 | | 3.500 | 62 | 0,20 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2028 | $ | 1.100 | 35 | 0,12 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | | 1.500 | 112 | 0,37 |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,545 | 20.03.2024 | ZAR | 13.700 | (22) | (0,07) |
| Zahlung | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,600 | 19.06.2024 | | 7.100 | (12) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,750 | 20.03.2024 | | 24.780 | 42 | 0,14 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 7,800 | 19.12.2023 | | 3.100 | 9 | 0,03 |
| Erhalt | 3-Month ZAR-JIBAR | 8,000 | 19.12.2023 | | 8.400 | 25 | 0,08 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,750 | 20.06.2023 | CZK | 3.400 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,750 | 20.03.2024 | | 45.500 | (1) | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,810 | 20.03.2024 | | 400 | 0 | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,838 | 19.06.2024 | | 19.300 | 7 | 0,02 |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 1,945 | 20.03.2024 | | 56.900 | (39) | (0,13) |
| Zahlung | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,000 | 19.06.2024 | | 53.770 | (1) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month CZK-PRIBOR | 2,500 | 20.03.2024 | | 39.000 | 63 | 0,21 |
| Erhalt | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 20.06.2028 | € | 5.300 | 138 | 0,45 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 20.06.2028 | £ | 5.000 | 62 | 0,20 |
| Erhalt | 6-Month HKD-HIBOR | 2,715 | 19.09.2023 | HKD | 7.700 | 14 | 0,05 |
| Erhalt | 6-Month HKD-HIBOR | 2,785 | 19.12.2023 | | 25.900 | 131 | 0,43 |
| Zahlung | 6-Month HKD-HIBOR | 2,815 | 19.12.2023 | | 12.400 | (53) | (0,17) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 0,830 | 21.11.2022 | HUF | 399.900 | (3) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,250 | 19.09.2023 | | 2.542.600 | (295) | (0,97) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,500 | 20.03.2024 | | 235.800 | (25) | (0,08) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 1,500 | 19.06.2024 | | 230.740 | 11 | 0,04 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,535 | 20.03.2024 | | 174.200 | (17) | (0,06) |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 2,000 | 20.03.2024 | | 307.200 | 47 | 0,15 |
| Erhalt | 6-Month HUF-BBR | 2,250 | 19.12.2023 | | 3.186.900 | 664 | 2,18 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,309 | 31.10.2028 | ¥ | 710.000 | 218 | 0,72 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,372 | 22.10.2028 | | 1.740.000 | 535 | 1,76 |
| Zahlung | 6-Month JPY-LIBOR | 0,380 | 18.06.2028 | | 1.560.000 | (161) | (0,53) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,540 | 08.12.2022 | MXN | 29.200 | (45) | (0,15) |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,035 | 22.02.2024 | | 31.550 | 43 | 0,14 |
| Erhalt | 28-Day MXN-TIIE | 8,520 | 28.12.2023 | | 14.300 | 35 | 0,12 |
| | | | | | | $ 1.714 | 5,63 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | | **$ 1.714** | **5,63** |

**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 | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Call - OTC AUD versus USD | 0,765 $ | 29.07.2019 | 5.000 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

**ZINSSWAPS**

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,345 % | 23.11.2023 | ILS | 5.900 | $ 0 | $ 61 | $ 61 | 0,20 |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,755 | 07.02.2024 | KRW | 2.068.600 | 9 | 18 | 27 | 0,09 |
| | Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,965 | 20.03.2024 | | 974.800 | (12) | (9) | (21) | (0,07) |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 2,100 | 19.09.2023 | | 2.442.500 | 11 | 50 | 61 | 0,20 |
| BPS | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 1,480 | 30.11.2023 | ILS | 6.000 | 0 | (73) | (73) | (0,24) |
| | Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,965 | 20.03.2024 | KRW | 1.592.000 | (14) | (22) | (36) | (0,12) |
| CBK | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 1,373 | 07.09.2023 | ILS | 11.032 | 0 | (127) | (127) | (0,42) |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,202 | 19.09.2023 | | 10.400 | 0 | 94 | 94 | 0,31 |

| Kontrahent | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 1,060 % | 15.02.2024 | ILS 3.100 | $ 0 | $ (17) | $ (17) | (0,05) |
| GLM | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 1,053 | 20.06.2023 | 2.560 | 0 | (12) | (12) | (0,04) |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 1,026 | 19.02.2024 | 2.300 | 0 | (11) | (11) | (0,04) |
| | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 0,960 | 21.03.2023 | 37.200 | 0 | (172) | (172) | (0,57) |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 0,967 | 19.06.2024 | 3.000 | 0 | 8 | 8 | 0,03 |
| HUS | Erhalt | 1-Year ILS-TELBOR | 1,035 | 25.03.2024 | 3.900 | 1 | (20) | (19) | (0,06) |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 0,853 | 21.03.2023 | 36.100 | 0 | 124 | 124 | 0,41 |
| | Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,773 | 20.03.2024 | KRW 2.300.100 | 0 | (33) | (33) | (0,11) |
| | Erhalt | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,965 | 20.03.2024 | 1.147.000 | (9) | (17) | (26) | (0,08) |
| | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 2,100 | 19.09.2023 | 3.582.600 | 0 | 89 | 89 | 0,29 |
| JPM | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,030 | 19.06.2024 | ILS 2.900 | 0 | 11 | 11 | 0,03 |
| | Zahlung | 1-Year ILS-TELBOR | 1,280 | 11.01.2024 | 17.620 | 0 | 155 | 155 | 0,51 |
| SCX | Zahlung | 3-Month KRW-KORIBOR | 1,755 | 07.02.2024 | KRW 1.943.000 | 10 | 15 | 25 | 0,08 |
| | | | | | | $ (4) | $ 112 | $ 108 | 0,35 |

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | AUD | 307 | $ | 214 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | CAD | 4.990 | | 3.764 | 0 | (54) | (54) | (0,18) |
| | 07/2019 | € | 75 | | 85 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 807 | AUD | 1.156 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 1.822 | CAD | 2.396 | 12 | 0 | 12 | 0,04 |
| | 07/2019 | | 10 | € | 9 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 3 | ¥ | 300 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 18 | PLN | 69 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4 | ZAR | 59 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | AUD | 1.121 | $ | 784 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 08/2019 | CAD | 2.389 | | 1.818 | 0 | (12) | (12) | (0,04) |
| | 08/2019 | NOK | 14.200 | | 1.633 | 0 | (35) | (35) | (0,11) |
| | 08/2019 | $ | 42 | CZK | 959 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | AUD | 900 | $ | 621 | 0 | (12) | (12) | (0,04) |
| | 09/2019 | $ | 1.900 | BRL | 7.417 | 24 | 0 | 24 | 0,08 |
| | 09/2019 | | 347 | CNH | 2.408 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 500 | COP | 1.631.050 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 299 | IDR | 4.407.892 | 10 | 0 | 10 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 21 | ILS | 73 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | CLP | 1.176.402 | $ | 1.688 | 0 | (46) | (46) | (0,15) |
| | 07/2019 | PEN | 575 | | 175 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 174 | BRL | 667 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 20 | CAD | 26 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 204 | € | 180 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 701 | £ | 553 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 113 | ¥ | 12.144 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.434 | NZD | 2.150 | 10 | 0 | 10 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 233 | PEN | 770 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | BRL | 667 | $ | 174 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 115 | | 131 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 550 | | 698 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 08/2019 | ¥ | 10.844 | | 101 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | NZD | 2.150 | | 1.435 | 0 | (10) | (10) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ | 46 | MXN | 922 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | AUD | 1.100 | $ | 756 | 0 | (18) | (18) | (0,06) |
| | 09/2019 | COP | 1.024.058 | | 303 | 0 | (14) | (14) | (0,05) |
| | 09/2019 | £ | 188 | | 239 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | IDR | 8.736.450 | | 595 | 0 | (18) | (18) | (0,06) |
| | 09/2019 | KRW | 222.748 | | 189 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 09/2019 | PHP | 21.265 | | 404 | 0 | (10) | (10) | (0,03) |
| | 09/2019 | SEK | 2.000 | | 209 | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| | 09/2019 | SGD | 349 | | 256 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 200 | ARS | 10.294 | 23 | 0 | 23 | 0,08 |
| | 09/2019 | | 2.467 | CAD | 3.300 | 62 | 0 | 62 | 0,20 |
| | 09/2019 | | 1.100 | CZK | 24.620 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 2.371 | NZD | 3.600 | 51 | 0 | 51 | 0,16 |
| | 09/2019 | | 174 | PEN | 575 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 600 | RON | 2.512 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 2.337 | SEK | 22.000 | 45 | 0 | 45 | 0,15 |
| | 10/2019 | MXN | 922 | $ | 46 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 2.748 | | 644 | 0 | (16) | (16) | (0,05) |
| | 11/2019 | $ | 929 | TWD | 29.330 | 23 | 0 | 23 | 0,08 |
| BRC | 07/2019 | AUD | 342 | $ | 237 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 07/2019 | HUF | 446.063 | | 1.565 | 0 | (10) | (10) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 9 | ZAR | 126 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 3 | CZK | 68 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | MYR | 718 | $ | 172 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 500 | CZK | 11.372 | 10 | 0 | 10 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 100 | MXN | 1.938 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 243 | | 4.798 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CBK | 07/2019 | COP | 1.024.058 | $ | 303 | $ 0 | $ (16) | $ (16) | (0,05) |
| | 07/2019 | € | 181 | | 206 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | SEK | 7.212 | | 757 | 0 | (20) | (20) | (0,07) |
| | 07/2019 | $ | 866 | AUD | 1.239 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 527 | CLP | 357.111 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 175 | COP | 558.656 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 560 | € | 492 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 111 | £ | 88 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 12 | HUF | 3.544 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 335 | ¥ | 36.500 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 16 | PLN | 61 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4 | ZAR | 55 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 811 | $ | 54 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 08/2019 | AUD | 1.114 | | 780 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 08/2019 | CZK | 26.994 | | 1.172 | 0 | (37) | (37) | (0,12) |
| | 08/2019 | € | 478 | | 545 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | MXN | 24.026 | | 1.214 | 0 | (28) | (28) | (0,09) |
| | 08/2019 | $ | 17 | CZK | 397 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 216 | MXN | 4.304 | 7 | 0 | 7 | 0,02 |
| | 09/2019 | CLP | 357.111 | $ | 527 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | COP | 678.600 | | 200 | 0 | (11) | (11) | (0,04) |
| | 09/2019 | HUF | 58.173 | | 200 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 09/2019 | PEN | 1.350 | | 400 | 0 | (9) | (9) | (0,03) |
| | 09/2019 | PLN | 770 | | 200 | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| | 09/2019 | $ | 300 | CZK | 6.777 | 4 | 0 | 4 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 567 | € | 500 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 22 | HKD | 174 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.207 | INR | 85.474 | 19 | 0 | 19 | 0,06 |
| | 09/2019 | | 800 | PEN | 2.647 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 815 | PHP | 42.719 | 16 | 0 | 16 | 0,05 |
| | 09/2019 | | 600 | THB | 18.774 | 13 | 0 | 13 | 0,04 |
| | 10/2019 | COP | 558.656 | $ | 175 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 4.304 | | 214 | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| | 10/2019 | $ | 426 | MXN | 8.373 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| DUB | 09/2019 | | 457 | THB | 14.502 | 17 | 0 | 17 | 0,05 |
| FBF | 07/2019 | | 174 | BRL | 665 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | BRL | 665 | $ | 173 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 697 | NOK | 6.000 | 8 | 0 | 8 | 0,03 |
| | 11/2019 | TWD | 3.488 | $ | 111 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| GLM | 07/2019 | BRL | 5.422 | | 1.390 | 0 | (24) | (24) | (0,08) |
| | 07/2019 | € | 267 | | 298 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 216 | BRL | 875 | 12 | 0 | 12 | 0,04 |
| | 07/2019 | | 910 | CLP | 617.409 | 1 | (1) | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 146 | COP | 465.402 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 454 | PEN | 1.503 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 08/2019 | RUB | 12.840 | $ | 196 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ | 278 | MXN | 5.536 | 8 | 0 | 8 | 0,03 |
| | 08/2019 | | 311 | RUB | 20.469 | 11 | 0 | 11 | 0,04 |
| | 09/2019 | CLP | 357.111 | $ | 527 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | CZK | 9.270 | | 400 | 0 | (15) | (15) | (0,05) |
| | 09/2019 | £ | 1.875 | | 2.386 | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| | 09/2019 | $ | 200 | ARS | 9.630 | 9 | 0 | 9 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 500 | CLP | 340.025 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.164 | HUF | 329.972 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 313 | IDR | 4.599.034 | 9 | 0 | 9 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 190 | KRW | 224.928 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 600 | MYR | 2.516 | 8 | 0 | 8 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 600 | PLN | 2.272 | 10 | 0 | 10 | 0,03 |
| | 09/2019 | | 700 | SGD | 955 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 295 | THB | 9.217 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 900 | TRY | 5.389 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | COP | 465.402 | $ | 145 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 5.399 | | 268 | 0 | (8) | (8) | (0,03) |
| | 10/2019 | $ | 333 | MXN | 6.497 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 12/2019 | CLP | 260.297 | $ | 383 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | ARS | 1.108 | | 22 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 07/2019 | TRY | 359 | | 61 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 175 | BRL | 667 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.032 | CAD | 1.359 | 8 | 0 | 8 | 0,03 |
| | 07/2019 | | 296 | CLP | 201.882 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 294 | € | 258 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 34 | HUF | 9.905 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 170 | ¥ | 18.333 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 4 | TRY | 22 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | BRL | 667 | $ | 174 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | CAD | 1.195 | | 911 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 08/2019 | ¥ | 18.333 | | 171 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 3 | MXN | 58 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | BRL | 1.627 | $ | 400 | 0 | (23) | (23) | (0,07) |
| | 09/2019 | CNH | 1.386 | | 200 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 09/2019 | £ | 125 | | 158 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 09/2019 | HKD | 706 | | 90 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | HUF | 58.149 | | 200 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 09/2019 | KRW | 823.719 | $ | 695 | $ 0 | $ (17) | $ (17) | (0,06) |
| | 09/2019 | SGD | 391 | | 286 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 09/2019 | THB | 6.603 | | 208 | 0 | (8) | (8) | (0,03) |
| | 09/2019 | $ | 300 | BRL | 1.160 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 1.810 | CAD | 2.400 | 30 | 0 | 30 | 0,09 |
| | 09/2019 | | 322 | CNH | 2.239 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 159 | £ | 125 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 145 | HKD | 1.133 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 600 | INR | 42.084 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 400 | KRW | 461.444 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | | 800 | RUB | 51.716 | 13 | 0 | 13 | 0,04 |
| | 09/2019 | | 518 | SGD | 701 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 497 | THB | 15.549 | 11 | 0 | 11 | 0,04 |
| | 10/2019 | | 420 | MXN | 8.269 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 11/2019 | TWD | 13.514 | $ | 432 | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| IND | 07/2019 | AUD | 439 | | 304 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 07/2019 | SEK | 10.117 | | 1.055 | 0 | (35) | (35) | (0,11) |
| JPM | 07/2019 | AUD | 2.488 | | 1.735 | 0 | (11) | (11) | (0,04) |
| | 07/2019 | € | 258 | | 292 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 07/2019 | £ | 1.941 | | 2.463 | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| | 07/2019 | PEN | 575 | | 174 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | PLN | 2.544 | | 675 | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 20 | € | 18 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5 | £ | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 13 | ¥ | 1.400 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 1.420 | SEK | 13.177 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 467 | $ | 31 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 08/2019 | SEK | 13.177 | | 1.424 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | CNH | 11.501 | | 1.658 | 0 | (15) | (15) | (0,05) |
| | 09/2019 | COP | 1.024.058 | | 303 | 0 | (14) | (14) | (0,05) |
| | 09/2019 | ILS | 26 | | 7 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | INR | 20.035 | | 284 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 09/2019 | KRW | 235.300 | | 200 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 1.675 | CAD | 2.200 | 11 | 0 | 11 | 0,04 |
| | 09/2019 | | 436 | HUF | 123.680 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 944 | NOK | 8.000 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 09/2019 | | 400 | PHP | 20.832 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 600 | PLN | 2.256 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| | 09/2019 | | 4 | SGD | 5 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 303 | THB | 9.604 | 11 | 0 | 11 | 0,04 |
| | 10/2019 | | 191 | MXN | 3.742 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 173 | PEN | 575 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 11/2019 | TWD | 12.328 | $ | 394 | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| MSB | 07/2019 | $ | 8 | TRY | 46 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | KRW | 346.403 | $ | 295 | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| | 09/2019 | $ | 50 | RUB | 3.323 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | | 32 | ¥ | 3.423 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 3.423 | $ | 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 232 | NOK | 2.000 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 09/2019 | HKD | 977 | $ | 125 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RBC | 07/2019 | CAD | 119 | | 91 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | BRL | 403 | | 100 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 09/2019 | CLP | 141.961 | | 200 | 0 | (9) | (9) | (0,03) |
| | 09/2019 | $ | 200 | BRL | 780 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 09/2019 | | 200 | CNH | 1.377 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | PEN | 1.001 | $ | 295 | 0 | (8) | (8) | (0,03) |
| RYL | 07/2019 | $ | 319 | BRL | 1.219 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 426 | SEK | 4.000 | 5 | 0 | 5 | 0,02 |
| | 08/2019 | BRL | 1.219 | $ | 318 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | $ | 22 | IDR | 315.099 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | | 903 | RON | 3.784 | 6 | 0 | 6 | 0,02 |
| SCX | 07/2019 | SEK | 13.025 | $ | 1.377 | 0 | (27) | (27) | (0,09) |
| | 07/2019 | TRY | 19 | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 11 | CAD | 15 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 304 | £ | 240 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 719 | NZD | 1.075 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 7 | TRY | 40 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | NZD | 1.075 | $ | 720 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 09/2019 | KRW | 79.397 | | 67 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 09/2019 | NZD | 500 | | 326 | 0 | (11) | (11) | (0,04) |
| | 09/2019 | RUB | 6.367 | | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | SGD | 68 | | 50 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 09/2019 | THB | 15.960 | | 500 | 0 | (22) | (22) | (0,07) |
| | 09/2019 | $ | 1.079 | IDR | 15.626.775 | 19 | 0 | 19 | 0,06 |
| | 09/2019 | | 500 | PLN | 1.873 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| SOG | 07/2019 | | 6 | TRY | 37 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | ZAR | 3.303 | $ | 227 | 0 | (7) | (7) | (0,02) |
| SSB | 07/2019 | € | 282 | | 315 | 0 | (6) | (6) | (0,02) |
| | 07/2019 | ¥ | 57.400 | | 530 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 07/2019 | NZD | 4.300 | | 2.851 | 0 | (37) | (37) | (0,12) |
| | 07/2019 | $ | 43 | AUD | 62 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 20 | HKD | 153 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | | 61 | AUD | 88 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.)

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 08/2019 | $ | 10 | MXN | 197 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | COP | 902.493 | $ | 267 | 0 | (13) | (13) | (0,04) |
| UAG | 07/2019 | AUD | 84 | | 58 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 14.700 | | 137 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 1.123 | | 340 | 0 | (2) | (2) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 329 | BRL | 1.328 | 17 | 0 | 17 | 0,06 |
| | 08/2019 | | 137 | ¥ | 14.700 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | BRL | 387 | $ | 100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | ILS | 6 | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 09/2019 | MYR | 1.740 | | 416 | 0 | (5) | (5) | (0,02) |
| | 09/2019 | SGD | 585 | | 430 | 0 | (4) | (4) | (0,01) |
| | 09/2019 | $ | 134 | CNH | 928 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | RON | 512 | $ | 120 | 0 | (3) | (3) | (0,01) |
| | 10/2019 | $ | 338 | PEN | 1.123 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | | | | | | $ 683 | $ (869) | $ (186) | (0,61) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | $ | 88 | CHF | 88 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,01 |
| BPS | 07/2019 | | 4 | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | CHF | 89 | $ | 91 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 88 | CHF | 88 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 91 | | 89 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | | 88 | | 89 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| HUS | 07/2019 | CHF | 90 | $ | 92 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 92 | CHF | 90 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | CHF | 1 | $ | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 8 | $ 0 | $ 8 | 0,03 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | € | 5.589 | $ | 6.352 | $ 0 | $ (13) | $ (13) | (0,04) |
| | 08/2019 | $ | 6.368 | € | 5.589 | 13 | 0 | 13 | 0,04 |
| BPS | 07/2019 | € | 5.630 | $ | 6.401 | 0 | (11) | (11) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 77 | € | 68 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 6.371 | | 5.589 | 10 | 0 | 10 | 0,03 |
| BRC | 07/2019 | | 6.273 | | 5.609 | 115 | 0 | 115 | 0,38 |
| CBK | 07/2019 | € | 5.762 | $ | 6.549 | 0 | (13) | (13) | (0,04) |
| | 07/2019 | $ | 5 | € | 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 6.369 | | 5.589 | 13 | 0 | 13 | 0,04 |
| GLM | 07/2019 | | 259 | | 230 | 3 | 0 | 3 | 0,01 |
| MYI | 07/2019 | | 6.157 | | 5.507 | 113 | 0 | 113 | 0,37 |
| RBC | 07/2019 | € | 107 | $ | 122 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | $ | 103 | € | 91 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € | 44 | $ | 49 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 11 | € | 10 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 106 | | 95 | 2 | 0 | 2 | 0,01 |
| TOR | 07/2019 | | 6.272 | | 5.609 | 116 | 0 | 116 | 0,38 |
| | | | | | | $ 387 | $ (38) | $ 349 | 1,14 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | $ | 3 | £ | 2 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ | 110 | $ | 140 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 4 | £ | 3 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 136 | | 107 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | £ | 107 | $ | 136 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 139 | £ | 109 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 136 | | 107 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | £ | 1 | $ | 1 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | $ | 3 | £ | 2 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 135 | | 106 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | | 130 | | 103 | 1 | 0 | 1 | 0,01 |
| | | | | | | $ 3 | $ (1) | $ 2 | 0,01 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 281** | **0,92** |
| **Summe Anlagen** | **$ 31.302** | **102,82** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (860)** | **(2,82)** |
| **Nettovermögen** | **$ 30.442** | **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) Mit dem Fonds verbunden.**

**Barmittel in Höhe von USD 1.744 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 290 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(b) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 2,550 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 2.900 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 | $ (2.965) | $ 2.900 | $ 2.900 | 9,53 |
| SSB | 1,350 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 774 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,350 % fällig am 31.08.2021 | (794) | 774 | 774 | 2,54 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (3.759)** | **$ 3.674** | **$ 3.674** | **12,07** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 3.079 | $ 26.004 | $ 0 | $ 29.083 |
| Finanzderivate[3] | 224 | 1.995 | 0 | 2.219 |
| **Summen** | **$ 3.303** | **$ 27.999** | **$ 0** | **$ 31.302** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 5.190 | $ 39.614 | $ 0 | $ 44.804 |
| Finanzderivate[3] | 662 | 2.092 | 0 | 2.754 |
| **Summen** | **$ 5.852** | **$ 41.706** | **$ 0** | **$ 47.558** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 73 | $ 0 | $ 73 |
| BPS | (32) | 0 | (32) |
| BRC | 114 | 0 | 114 |
| CBK | (99) | 20 | (79) |
| FBF | 6 | 0 | 6 |
| GLM | (154) | 260 | 106 |
| HUS | 135 | 0 | 135 |
| IND | (39) | 0 | (39) |
| JPM | 126 | (260) | (134) |
| MSB | (3) | 0 | (3) |
| MYI | 116 | 10 | 126 |
| RBC | (19) | 0 | (19) |
| RYL | 12 | 0 | 12 |
| SCX | (14) | 0 | (14) |
| SOG | (7) | 0 | (7) |
| SSB | (43) | 0 | (43) |
| TOR | 104 | 0 | 104 |
| UAG | 5 | 0 | 5 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 34,33 | 34,82 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 49,14 | 47,95 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 12,07 | 3,65 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,73 | 1,28 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 5,63 | 3,17 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,92 | 0,87 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 44,34 | 49,64 |
| US-Regierungsbehörden | 11,78 | 7,16 |
| Non-Agency-MBS | 1,96 | 2,32 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 13,63 | 10,19 |
| Staatsemissionen | 1,64 | 0,96 |
| Kurzfristige Instrumente | 12,07 | 6,14 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 10,12 | 10,01 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,73 | 1,28 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Zinsswaps | 5,63 | 3,17 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Zinsswaps | 0,35 | 0,03 |
| Devisenterminkontrakte | (0,61) | 0,56 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 1,18 | 0,28 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (2,82) | 8,26 |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **APT Pipelines Ltd.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 22.03.2030 | £ | 550 | £ | 597 | 0,14 |
| **BHP Billiton Finance Ltd.** | | | | | |
| 4,300 % fällig am 25.09.2042 | | 1.000 | | 1.336 | 0,31 |
| **Goodman Australia Finance Pty. Ltd.** | | | | | |
| 1,375 % fällig am 27.09.2025 | € | 200 | | 184 | 0,04 |
| **Scentre Group Trust** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 23.03.2027 | $ | 600 | | 486 | 0,12 |
| **Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 26.04.2028 | € | 300 | | 289 | 0,07 |
| 3,375 % fällig am 30.04.2025 | $ | 100 | | 80 | 0,02 |
| **Westfield America Management Ltd.** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 30.03.2029 | £ | 500 | | 515 | 0,12 |
| Summe Australien | | | | 3.487 | 0,82 |
| **ÖSTERREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **IMMOFINANZ AG** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 27.01.2023 | € | 1.100 | | 1.030 | 0,24 |
| **BELGIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Anheuser-Busch InBev S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 07.03.2025 | £ | 300 | | 301 | 0,07 |
| 2,850 % fällig am 25.05.2037 | | 1.200 | | 1.189 | 0,28 |
| **KBC Group NV** | | | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (e)(g) | € | 1.800 | | 1.581 | 0,37 |
| 4,750 % fällig am 05.03.2024 (e)(g) | | 400 | | 380 | 0,09 |
| Summe Belgien | | | | 3.451 | 0,81 |
| **BRASILIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.10.2029 | £ | 1.200 | | 1.252 | 0,29 |
| **KANADA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 1.600 | | 1.537 | 0,36 |
| **Viterra, Inc.** | | | | | |
| 5,950 % fällig am 01.08.2020 | $ | 100 | | 81 | 0,02 |
| | | | | 1.618 | 0,38 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Province of Alberta** | | | | | |
| 1,000 % fällig am 15.11.2021 | £ | 1.300 | | 1.298 | 0,30 |
| **Province of Quebec** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.12.2023 | | 1.000 | | 1.016 | 0,24 |
| | | | | 2.314 | 0,54 |
| Summe Kanada | | | | 3.932 | 0,92 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** | | | | | |
| 1,544 % fällig am 28.07.2038 | | 2.400 | | 2.157 | 0,51 |
| 4,750 % fällig am 28.04.2029 (i) | | 500 | | 543 | 0,13 |
| 6,500 % fällig am 28.07.2033 | | 82 | | 112 | 0,02 |
| 7,030 % fällig am 28.01.2029 | | 163 | | 201 | 0,05 |
| 8,280 % fällig am 28.10.2022 | | 77 | | 84 | 0,02 |
| Summe Cayman Inseln | | | | 3.097 | 0,73 |
| **DÄNEMARK** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | | | | |
| 4,000 % fällig am 04.04.2025 | | 200 | | 212 | 0,05 |
| **Danske Bank A/S** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 06.04.2022 (e)(g) | € | 400 | | 379 | 0,09 |
| **Orsted A/S** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 17.05.2027 | £ | 1.300 | £ | 1.341 | 0,31 |
| 4,875 % fällig am 12.01.2032 | | 250 | | 323 | 0,08 |
| Summe Dänemark | | | | 2.255 | 0,53 |
| **FINNLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Ahlstrom-Munksjo Oyj** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.06.2022 | € | 100 | | 91 | 0,02 |
| **Teollisuuden Voima Oyj** | | | | | |
| 2,000 % fällig am 08.05.2024 | | 200 | | 187 | 0,05 |
| Summe Finnland | | | | 278 | 0,07 |
| **FRANKREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AXA S.A.** | | | | | |
| 5,453 % fällig am 04.03.2026 (e) | £ | 1.800 | | 1.995 | 0,47 |
| 5,625 % fällig am 16.01.2054 | | 700 | | 818 | 0,19 |
| **Banque Federative du Credit Mutuel S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 19.12.2024 | | 800 | | 804 | 0,19 |
| 2,250 % fällig am 18.12.2023 | | 900 | | 928 | 0,22 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 23.01.2027 | € | 200 | | 194 | 0,05 |
| 3,375 % fällig am 23.01.2026 | £ | 1.800 | | 1.913 | 0,45 |
| 4,400 % fällig am 14.08.2028 | $ | 300 | | 256 | 0,06 |
| **BPCE S.A.** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 26.09.2023 | € | 200 | | 183 | 0,04 |
| 2,125 % fällig am 16.12.2022 | £ | 400 | | 411 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 16.04.2029 | | 1.000 | | 1.195 | 0,28 |
| **CNP Assurances** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 27.06.2028 (e)(g) | € | 400 | | 385 | 0,09 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | | |
| 0,750 % fällig am 05.12.2023 | | 300 | | 277 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 23.06.2026 (e)(g) | £ | 300 | | 341 | 0,08 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 08.12.2023 | | 1.400 | | 1.426 | 0,33 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 21.09.2028 | $ | 1.600 | | 1.380 | 0,32 |
| 5,125 % fällig am 22.09.2050 | £ | 400 | | 573 | 0,13 |
| 5,500 % fällig am 27.03.2037 | | 1.000 | | 1.388 | 0,33 |
| 5,500 % fällig am 17.10.2041 | | 1.300 | | 1.873 | 0,44 |
| 6,125 % fällig am 02.06.2034 | | 900 | | 1.291 | 0,30 |
| **Engie S.A.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2060 | | 200 | | 322 | 0,08 |
| **Ingenico Group S.A.** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 13.09.2024 | € | 700 | | 625 | 0,15 |
| **Orange S.A.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.01.2032 | £ | 300 | | 328 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 05.12.2025 | | 1.250 | | 1.521 | 0,36 |
| 5,625 % fällig am 23.01.2034 | | 700 | | 966 | 0,23 |
| **Sodexo S.A.** | | | | | |
| 1,750 % fällig am 26.06.2028 | | 600 | | 604 | 0,14 |
| **TDF Infrastructure S.A.S.** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 07.04.2026 | € | 1.000 | | 948 | 0,22 |
| **Teleperformance** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 02.07.2025 | | 300 | | 283 | 0,07 |
| Summe Frankreich | | | | 23.228 | 5,46 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Deutsche Bahn Finance GmbH** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 13.02.2026 | £ | 1.500 | | 1.540 | 0,36 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 12.02.2024 | | 1.800 | | 1.847 | 0,43 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b) | € | 700 | | 642 | 0,15 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b) | | 100 | | 91 | 0,02 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.06.2032 | £ | 400 | | 609 | 0,14 |
| **ProSiebenSat.1 Media SE** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.04.2021 | € | 200 | | 185 | 0,04 |
| **Schaeffler AG** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 26.03.2022 | | 400 | | 367 | 0,09 |
| **TLG Immobilien AG** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 28.05.2026 | € | 700 | £ | 627 | 0,15 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | | | |
| 1,250 % fällig am 01.08.2022 | | 400 | | 367 | 0,09 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 01.04.2022 | | 1.300 | | 1.174 | 0,28 |
| Summe Deutschland | | | | 7.449 | 1,75 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 08.08.2025 | £ | 350 | | 362 | 0,09 |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | $ | 1.050 | | 862 | 0,20 |
| 3,800 % fällig am 09.06.2023 | | 1.400 | | 1.142 | 0,27 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 100 | | 95 | 0,02 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | | 2.461 | 0,58 |
| **IRLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | $ | 600 | | 486 | 0,12 |
| **Bank of Ireland** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (e)(g) | € | 900 | | 852 | 0,20 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 04.11.2020 | £ | 2.700 | | 2.854 | 0,67 |
| 5,875 % fällig am 18.01.2033 | | 2.300 | | 2.858 | 0,67 |
| | | | | 7.050 | 1,66 |
| | | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (f)** | | 2.500 | | 224 | 0,05 |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (f)** | | 297.580 | | 30.431 | 7,15 |
| | | | | 30.655 | 7,20 |
| | | **PARI (000S)** | | | |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Taurus UK DAC** | | | | | |
| 1,654 % fällig am 17.11.2027 | £ | 347 | | 346 | 0,08 |
| Summe Irland | | | | 38.051 | 8,94 |
| **ITALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **UniCredit SpA** | | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 2.950 | | 2.650 | 0,62 |
| **JAPAN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 0,980 % fällig am 09.10.2023 | € | 100 | | 92 | 0,02 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | | |
| 0,465 % fällig am 30.05.2024 | | 600 | | 541 | 0,13 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 21.11.2022 | | 300 | | 278 | 0,06 |
| Summe Japan | | | | 911 | 0,21 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | £ | 400 | | 366 | 0,09 |
| 2,875 % fällig am 31.07.2043 | | 2.828 | | 2.698 | 0,63 |
| 4,249 % fällig am 31.07.2043 | | 606 | | 616 | 0,14 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 1.600 | | 1.579 | 0,37 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 200 | | 193 | 0,05 |
| **CPUK Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,588 % fällig am 28.02.2042 | £ | 900 | | 963 | 0,23 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Glencore Finance Europe Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 26.03.2026 | £ | 1.600 | £ 1.625 | 0,38 |
| 6,000 % fällig am 03.04.2022 | | 300 | 333 | 0,08 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 09.08.2051 | | 100 | 99 | 0,02 |
| 5,875 % fällig am 13.05.2043 | | 100 | 151 | 0,04 |
| 6,450 % fällig am 10.12.2031 | | 300 | 436 | 0,10 |
| 6,750 % fällig am 03.12.2028 | | 400 | 533 | 0,12 |
| 7,125 % fällig am 14.02.2024 | | 600 | 728 | 0,17 |
| **HSBC Bank Capital Funding Sterling LP** | | | | |
| 5,844 % fällig am 05.11.2031 (e) | | 1.150 | 1.487 | 0,35 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.11.2025 | € | 300 | 278 | 0,07 |
| 3,950 % fällig am 30.06.2022 | £ | 1.319 | 1.351 | 0,32 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | 13.436 | 3,16 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Allergan Funding SCS** | | | | |
| 1,500 % fällig am 15.11.2023 | € | 200 | 187 | 0,04 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 1,625 % fällig am 31.01.2028 | | 100 | 90 | 0,02 |
| 3,000 % fällig am 16.10.2029 | £ | 1.400 | 1.364 | 0,32 |
| 3,250 % fällig am 18.07.2027 | | 800 | 806 | 0,19 |
| 3,625 % fällig am 10.04.2031 | | 2.000 | 2.014 | 0,47 |
| **Bevco Lux SARL** | | | | |
| 1,750 % fällig am 09.02.2023 | € | 1.500 | 1.393 | 0,33 |
| **Blackstone Property Partners Europe Holdings SARL** | | | | |
| 2,200 % fällig am 24.07.2025 | | 900 | 852 | 0,20 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | | 900 | 826 | 0,20 |
| **Dream Global Funding SARL** | | | | |
| 1,750 % fällig am 28.06.2026 | | 1.000 | 905 | 0,21 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | | 700 | 648 | 0,15 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | | 1.000 | 955 | 0,23 |
| Summe Luxemburg | | | 10.040 | 2,36 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aegon Bank NV** | | | | |
| 0,625 % fällig am 21.06.2024 | | 400 | 361 | 0,08 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 4,625 % fällig am 23.05.2029 | £ | 1.050 | 1.219 | 0,29 |
| 5,250 % fällig am 14.09.2027 | | 750 | 891 | 0,21 |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (e)(g) | € | 200 | 187 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (e)(g) | | 400 | 397 | 0,09 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 10.10.2025 | £ | 1.200 | 1.249 | 0,29 |
| **E.ON International Finance BV** | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.10.2037 | | 1.000 | 1.434 | 0,34 |
| 6,375 % fällig am 07.06.2032 | | 968 | 1.376 | 0,32 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 3,625 % fällig am 25.05.2027 | $ | 1.550 | 1.225 | 0,29 |
| 5,625 % fällig am 14.08.2024 | £ | 750 | 882 | 0,21 |
| 5,750 % fällig am 14.09.2040 | | 700 | 960 | 0,23 |
| **IMCD NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 26.03.2025 | € | 500 | 460 | 0,11 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.11.2030 | | 200 | 206 | 0,05 |
| 3,000 % fällig am 18.02.2026 | £ | 1.400 | 1.465 | 0,34 |
| **innogy Finance BV** | | | | |
| 0,750 % fällig am 30.11.2022 | € | 600 | 552 | 0,13 |
| 4,750 % fällig am 31.01.2034 | £ | 1.300 | 1.621 | 0,38 |
| 6,125 % fällig am 06.07.2039 | | 300 | 448 | 0,11 |
| 6,250 % fällig am 03.06.2030 | | 250 | 342 | 0,08 |
| **Koninklijke KPN NV** | | | | |
| 5,000 % fällig am 18.11.2026 | | 300 | 336 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 17.09.2029 | | 100 | 116 | 0,03 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 1,375 % fällig am 07.03.2024 | € | 200 | 184 | 0,04 |
| **Nederlandse Waterschapsbank NV** | | | | |
| 5,375 % fällig am 07.06.2032 | £ | 100 | 145 | 0,03 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (e) | € | 400 | 396 | 0,09 |
| 4,625 % fällig am 13.01.2048 | | 600 | 618 | 0,15 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (e) | € | 1.200 | £ 1.317 | 0,31 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | $ | 200 | 158 | 0,04 |
| 4,441 % fällig am 24.04.2023 | | 1.400 | 1.144 | 0,27 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.04.2022 | € | 1.900 | 1.682 | 0,40 |
| **Vesteda Finance BV** | | | | |
| 1,500 % fällig am 24.05.2027 | | 200 | 187 | 0,04 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 1,875 % fällig am 07.09.2021 | £ | 500 | 502 | 0,12 |
| **WPC Eurobond BV** | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.04.2027 | € | 600 | 564 | 0,13 |
| 2,250 % fällig am 09.04.2026 | | 1.100 | 1.051 | 0,25 |
| Summe Niederlande | | | 23.675 | 5,57 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **SingTel Group Treasury Pte. Ltd.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 28.08.2028 | $ | 1.500 | 1.269 | 0,30 |
| **Temasek Financial Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 26.07.2040 | £ | 970 | 1.482 | 0,35 |
| Summe Singapur | | | 2.751 | 0,65 |
| **SLOWAKEI** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Zapadoslovenska Energetika A/S** | | | | |
| 1,750 % fällig am 02.03.2028 | € | 300 | 290 | 0,07 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Abertis Infraestructuras S.A.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 27.11.2026 | £ | 1.100 | 1.128 | 0,27 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 21.06.2026 | € | 200 | 182 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (e)(g) | | 200 | 185 | 0,04 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (e)(g) | | 1.000 | 921 | 0,22 |
| 8,875 % fällig am 14.04.2021 (e)(g) | | 400 | 400 | 0,09 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 29.09.2023 (e)(g) | | 200 | 182 | 0,04 |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (e)(g) | | 800 | 754 | 0,18 |
| Summe Spanien | | | 3.752 | 0,88 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 2,250 % fällig am 07.03.2020 | £ | 2.500 | 2.525 | 0,60 |
| 3,750 % fällig am 07.12.2027 | | 1.750 | 2.122 | 0,50 |
| 4,500 % fällig am 07.06.2029 | | 1.300 | 1.699 | 0,40 |
| 5,625 % fällig am 07.06.2032 | | 1.400 | 2.091 | 0,49 |
| 6,000 % fällig am 07.12.2028 | | 900 | 1.282 | 0,30 |
| **International Bank for Reconstruction & Development** | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.06.2032 | | 700 | 1.067 | 0,25 |
| Summe übernational | | | 10.786 | 2,54 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Castellum AB** | | | | |
| 2,125 % fällig am 20.11.2023 | € | 200 | 190 | 0,04 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (g) | $ | 900 | 780 | 0,18 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 1,000 % fällig am 24.06.2027 | € | 600 | 545 | 0,13 |
| 2,125 % fällig am 12.09.2025 | £ | 1.200 | 1.192 | 0,28 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (e)(g) | $ | 300 | 252 | 0,06 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (g) | | 2.000 | 1.670 | 0,39 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.04.2026 | | 500 | 420 | 0,10 |
| Summe Schweiz | | | 4.859 | 1,14 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Anglian Water Services Financing PLC** | | | | |
| 1,625 % fällig am 10.08.2025 | £ | 1.700 | £ 1.696 | 0,40 |
| 2,750 % fällig am 26.10.2029 | | 500 | 537 | 0,13 |
| **Annington Funding PLC** | | | | |
| 2,646 % fällig am 12.07.2025 | | 2.000 | 2.024 | 0,48 |
| 3,184 % fällig am 12.07.2029 | | 700 | 726 | 0,17 |
| 3,685 % fällig am 12.07.2034 | | 1.450 | 1.541 | 0,36 |
| **Arqiva Financing PLC** | | | | |
| 5,340 % fällig am 30.12.2037 | | 1.000 | 1.205 | 0,28 |
| **Assura Financing PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 19.07.2028 | | 800 | 853 | 0,20 |
| **Aviva PLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 04.06.2050 | | 200 | 218 | 0,05 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (g) | $ | 3.250 | 2.790 | 0,66 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 1.285 | 1.478 | 0,35 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | | 300 | 300 | 0,07 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | | 1.300 | 1.339 | 0,31 |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | | 850 | 869 | 0,20 |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | $ | 400 | 335 | 0,08 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (e)(g) | € | 1.000 | 906 | 0,21 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (e)(g) | £ | 200 | 209 | 0,05 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (e)(g) | | 400 | 418 | 0,10 |
| 7,750 % fällig am 15.09.2023 (e)(g) | $ | 2.300 | 1.854 | 0,44 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (e)(g) | £ | 300 | 318 | 0,07 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (e)(g) | € | 1.000 | 970 | 0,23 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (e)(g) | $ | 200 | 165 | 0,04 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 04.09.2026 | £ | 380 | 416 | 0,10 |
| 7,250 % fällig am 12.03.2024 | | 700 | 862 | 0,20 |
| **BP Capital Markets PLC** | | | | |
| 1,827 % fällig am 08.09.2025 | | 1.400 | 1.425 | 0,33 |
| **BPHA Finance PLC** | | | | |
| 4,816 % fällig am 11.04.2044 | | 300 | 405 | 0,09 |
| **British Land Co. PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.09.2029 | | 1.900 | 1.902 | 0,45 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 21.11.2031 | | 600 | 631 | 0,15 |
| **Bunzl Finance PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 11.06.2025 | | 1.100 | 1.109 | 0,26 |
| **BUPA Finance PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 05.04.2024 | | 1.100 | 1.120 | 0,26 |
| **Cadent Finance PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 22.09.2028 | | 1.450 | 1.445 | 0,34 |
| 2,750 % fällig am 22.09.2046 | | 700 | 686 | 0,16 |
| **Centrica PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 12.09.2044 | | 200 | 233 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 13.03.2029 | | 393 | 457 | 0,11 |
| **Clarion Funding PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 18.01.2029 | | 1.200 | 1.258 | 0,30 |
| 3,125 % fällig am 19.04.2048 | | 300 | 321 | 0,08 |
| **Compass Group PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 03.07.2029 | | 700 | 727 | 0,17 |
| **Connect Plus M25 Issuer PLC** | | | | |
| 2,607 % fällig am 31.03.2039 | | 1.181 | 1.274 | 0,30 |
| **CYBG PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.09.2026 | | 700 | 706 | 0,17 |
| 7,875 % fällig am 14.12.2028 | | 500 | 538 | 0,13 |
| **Drax Finco PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.05.2022 | | 1.500 | 1.533 | 0,36 |
| **EI Group PLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.02.2022 | | 100 | 103 | 0,02 |
| 6,375 % fällig am 26.09.2031 | | 100 | 109 | 0,03 |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | | 300 | 320 | 0,08 |
| 6,875 % fällig am 09.05.2025 | | 800 | 866 | 0,20 |
| **EMH Treasury PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 29.01.2044 | | 300 | 388 | 0,09 |
| **Experian Finance PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 27.09.2024 | | 600 | 615 | 0,14 |
| **FCE Bank PLC** | | | | |
| 2,727 % fällig am 03.06.2022 | | 200 | 202 | 0,05 |
| **Frontier Finance PLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 23.03.2022 | | 2.200 | 2.299 | 0,54 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Futures Treasury PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 08.02.2044 | £ | 700 | £ 783 | 0,18 |
| **GKN Holdings Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 19.09.2022 | | 200 | 218 | 0,05 |
| **GlaxoSmithKline Capital PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2045 | | 500 | 658 | 0,15 |
| 5,250 % fällig am 19.12.2033 | | 1.050 | 1.453 | 0,34 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 2,866 % fällig am 15.03.2036 | | 1.200 | 963 | 0,23 |
| 3,593 % fällig am 15.03.2035 | | 400 | 415 | 0,10 |
| 4,064 % fällig am 15.03.2035 | | 608 | 656 | 0,15 |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | | 800 | 928 | 0,22 |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | | 1.953 | 2.270 | 0,53 |
| 5,702 % fällig am 15.12.2034 | | 150 | 125 | 0,03 |
| **Guinness Partnership Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.10.2044 | | 100 | 123 | 0,03 |
| **Hammerson PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 27.10.2025 | | 800 | 824 | 0,19 |
| 6,000 % fällig am 23.02.2026 | | 300 | 351 | 0,08 |
| **Heathrow Finance PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.03.2027 | | 200 | 195 | 0,05 |
| 4,750 % fällig am 01.03.2024 | | 500 | 527 | 0,12 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.03.2046 | | 1.550 | 1.891 | 0,44 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 04.12.2024 | € | 400 | 377 | 0,09 |
| 2,256 % fällig am 13.11.2026 | £ | 900 | 901 | 0,21 |
| 2,625 % fällig am 16.08.2028 | | 1.400 | 1.433 | 0,34 |
| 3,000 % fällig am 22.07.2028 | | 2.100 | 2.192 | 0,52 |
| 3,000 % fällig am 29.05.2030 | | 1.900 | 1.957 | 0,46 |
| 3,900 % fällig am 25.05.2026 | $ | 500 | 411 | 0,10 |
| 5,100 % fällig am 05.04.2021 | | 650 | 534 | 0,13 |
| 5,750 % fällig am 20.12.2027 | £ | 100 | 121 | 0,03 |
| 5,875 % fällig am 28.09.2026 (e)(g) | | 600 | 631 | 0,15 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (e)(g) | € | 700 | 724 | 0,17 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 28.09.2026 | £ | 600 | 713 | 0,17 |
| **Informa PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 05.07.2026 | | 600 | 625 | 0,15 |
| **InterContinental Hotels Group PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 24.08.2026 | | 1.850 | 1.828 | 0,43 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 | | 194 | 181 | 0,04 |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | | 1.250 | 1.410 | 0,33 |
| **Juturna European Loan Conduit PLC** | | | | |
| 5,064 % fällig am 10.08.2033 | | 250 | 313 | 0,07 |
| **Karbon Homes Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.11.2047 | | 200 | 228 | 0,05 |
| **Land Securities Capital Markets PLC** | | | | |
| 1,974 % fällig am 08.02.2026 | | 1.300 | 1.322 | 0,31 |
| 2,399 % fällig am 08.02.2031 | | 600 | 628 | 0,15 |
| **LCR Finance PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.12.2038 | | 1.400 | 2.078 | 0,49 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 27.06.2064 | | 750 | 847 | 0,20 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | | 4.650 | 4.672 | 1,10 |
| 3,574 % fällig am 07.11.2028 | $ | 1.900 | 1.496 | 0,35 |
| 3,750 % fällig am 11.01.2027 | | 450 | 360 | 0,08 |
| **London Power Networks PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 01.03.2029 | £ | 800 | 838 | 0,20 |
| 5,125 % fällig am 31.03.2023 | | 150 | 171 | 0,04 |
| 6,125 % fällig am 07.06.2027 | | 300 | 389 | 0,09 |
| **Manchester Airport Group Funding PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 31.03.2039 | | 200 | 205 | 0,05 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 08.12.2023 | | 100 | 102 | 0,02 |
| 4,750 % fällig am 12.06.2025 | | 1.400 | 1.526 | 0,36 |
| **Marston's Issuer PLC** | | | | |
| 5,177 % fällig am 15.07.2032 | | 50 | 54 | 0,01 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 2,860 % fällig am 15.12.2030 | $ | 1.425 | 1.047 | 0,25 |
| 5,965 % fällig am 15.12.2025 | £ | 380 | 408 | 0,10 |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | | 515 | 586 | 0,14 |
| 6,469 % fällig am 15.09.2032 | | 1.100 | 1.245 | 0,29 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.03.2032 | | 700 | 723 | 0,17 |
| 3,750 % fällig am 16.07.2026 | | 950 | 1.084 | 0,25 |
| 5,625 % fällig am 29.11.2030 | £ | 200 | £ 275 | 0,06 |
| **National Express Group PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 11.11.2023 | | 1.700 | 1.724 | 0,41 |
| **National Grid Electricity Transmission PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 08.06.2027 | | 700 | 824 | 0,19 |
| **Nationwide Building Society** | | | | |
| 1,500 % fällig am 08.03.2026 | € | 700 | 641 | 0,15 |
| 3,250 % fällig am 20.01.2028 | £ | 450 | 491 | 0,12 |
| 3,622 % fällig am 26.04.2023 | $ | 200 | 160 | 0,04 |
| **Network Rail Infrastructure Finance PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.11.2035 | £ | 2.800 | 4.109 | 0,97 |
| **Next Group PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 26.08.2025 | | 900 | 923 | 0,22 |
| 3,625 % fällig am 18.05.2028 | | 900 | 939 | 0,22 |
| **Northern Gas Networks Finance PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 23.03.2040 | | 50 | 73 | 0,02 |
| **Northern Powergrid Yorkshire PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 05.07.2032 | | 300 | 374 | 0,09 |
| 5,125 % fällig am 04.05.2035 | | 200 | 274 | 0,06 |
| **Northumbrian Water Finance PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 05.10.2027 | | 300 | 308 | 0,07 |
| **Notting Hill Housing Trust** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.10.2048 | | 400 | 409 | 0,10 |
| **Pacific Quay Finance PLC** | | | | |
| 5,565 % fällig am 25.07.2034 | | 178 | 227 | 0,05 |
| **Peabody Capital PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 14.09.2048 | | 400 | 425 | 0,10 |
| **Places for People Homes Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 22.11.2028 | | 1.600 | 1.684 | 0,40 |
| **Places For People Treasury PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 17.08.2026 | | 1.450 | 1.467 | 0,34 |
| **Prudential PLC** | | | | |
| 5,560 % fällig am 20.07.2055 | | 400 | 428 | 0,10 |
| 6,125 % fällig am 19.12.2031 | | 100 | 135 | 0,03 |
| **Quadgas Finance PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 17.09.2029 | | 800 | 814 | 0,19 |
| **RAC Bond Co. PLC** | | | | |
| 4,565 % fällig am 06.05.2046 | | 950 | 946 | 0,22 |
| **RHP Finance PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 05.02.2048 | | 350 | 377 | 0,09 |
| **Rio Tinto Finance PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 11.12.2029 | | 1.000 | 1.208 | 0,28 |
| **Riverside Finance PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 05.12.2044 | | 300 | 361 | 0,08 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 19.09.2026 | | 300 | 304 | 0,07 |
| 3,125 % fällig am 28.03.2027 | | 1.500 | 1.527 | 0,36 |
| 3,498 % fällig am 15.05.2023 | $ | 1.300 | 1.033 | 0,24 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | | 1.300 | 1.057 | 0,25 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 1.500 | 1.228 | 0,29 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 900 | 768 | 0,18 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (e)(g) | | 1.200 | 969 | 0,23 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (e)(g) | | 1.200 | 1.019 | 0,24 |
| **Saga PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.05.2024 | £ | 200 | 167 | 0,04 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 14.01.2026 | | 1.100 | 1.178 | 0,28 |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | $ | 1.600 | 1.307 | 0,31 |
| 6,750 % fällig am 24.06.2024 (e)(g) | £ | 1.650 | 1.727 | 0,41 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (e)(g) | | 800 | 852 | 0,20 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 02.03.2026 | | 200 | 257 | 0,06 |
| **Scotland Gas Networks PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 21.12.2034 | | 300 | 394 | 0,09 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 05.12.2031 | | 1.300 | 1.384 | 0,33 |
| 6,250 % fällig am 07.06.2029 | | 300 | 413 | 0,10 |
| **Shop Direct Funding PLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.11.2022 | | 500 | 465 | 0,11 |
| **Society of Lloyd's** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | | 1.550 | 1.715 | 0,40 |
| **South Eastern Power Networks PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 05.06.2026 | | 300 | 368 | 0,09 |
| **Southern Electric Power Distribution PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 07.06.2032 | | 1.000 | 1.335 | 0,31 |
| **Southern Gas Networks PLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 03.02.2025 | £ | 300 | £ 312 | 0,07 |
| 3,100 % fällig am 15.09.2036 | | 1.000 | 1.082 | 0,25 |
| 4,875 % fällig am 21.03.2029 | | 300 | 376 | 0,09 |
| **SP Manweb PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 20.09.2027 | | 250 | 306 | 0,07 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | |
| 3,474 % fällig am 28.12.2031 | | 1.010 | 1.002 | 0,24 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 02.07.2027 (a) | € | 100 | 90 | 0,02 |
| **Student Finance PLC** | | | | |
| 2,666 % fällig am 30.09.2029 | £ | 750 | 744 | 0,17 |
| **Telereal Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,010 % fällig am 10.12.2033 | | 1.277 | 1.392 | 0,33 |
| **Telereal Securitisation PLC** | | | | |
| 4,090 % fällig am 10.12.2033 | | 1.300 | 1.349 | 0,32 |
| 4,974 % fällig am 10.12.2033 | | 434 | 495 | 0,12 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.10.2023 | € | 300 | 278 | 0,07 |
| 2,500 % fällig am 02.05.2025 | £ | 1.300 | 1.333 | 0,31 |
| **Tesco PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | | 50 | 56 | 0,01 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 720 | 920 | 0,22 |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | | 688 | 889 | 0,21 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 775 | 1.013 | 0,24 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 1.172 | 1.550 | 0,36 |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 1.221 | 1.610 | 0,38 |
| **Thames Water Utilities Finance PLC** | | | | |
| 1,875 % fällig am 24.01.2024 | | 100 | 100 | 0,02 |
| 3,500 % fällig am 25.02.2028 | | 400 | 436 | 0,10 |
| 5,050 % fällig am 30.06.2020 (h) | | 1.200 | 1.241 | 0,29 |
| 5,500 % fällig am 11.02.2041 | | 100 | 140 | 0,03 |
| **TP ICAP PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | | 1.000 | 1.047 | 0,25 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 1.500 | 1.537 | 0,36 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2021 | | 1.000 | 1.036 | 0,24 |
| 4,500 % fällig am 07.09.2023 | | 600 | 619 | 0,15 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | | 2.939 | 3.303 | 0,78 |
| 7,395 % fällig am 28.03.2024 | | 500 | 565 | 0,13 |
| **UNITE Group PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.10.2028 | | 1.400 | 1.471 | 0,35 |
| **Virgin Money Holdings UK PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2026 | | 100 | 101 | 0,02 |
| 8,750 % fällig am 10.11.2021 (e)(g) | | 700 | 754 | 0,18 |
| **Virgin Money PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 21.04.2020 | | 700 | 705 | 0,17 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 24.11.2026 | € | 1.100 | 1.008 | 0,24 |
| 3,000 % fällig am 12.08.2056 | £ | 100 | 89 | 0,02 |
| 3,375 % fällig am 08.08.2049 | | 1.300 | 1.252 | 0,29 |
| **Western Power Distribution East Midlands PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.12.2040 | | 300 | 469 | 0,11 |
| **Western Power Distribution South Wales PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 23.03.2040 | | 850 | 1.251 | 0,29 |
| **Western Power Distribution South West PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.05.2029 | | 400 | 409 | 0,10 |
| **Western Power Distribution West Midlands PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 16.04.2032 | | 900 | 1.229 | 0,29 |
| **Whitbread Group PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 16.10.2025 | | 500 | 518 | 0,12 |
| **Yorkshire Building Society** | | | | |
| 3,000 % fällig am 18.04.2025 | | 200 | 203 | 0,05 |
| **Yorkshire Water Finance PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.08.2029 | | 300 | 344 | 0,08 |
| | | | 163.128 | 38,35 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Alba PLC** | | | | |
| 0,956 % fällig am 15.12.2038 | | 1.333 | 1.259 | 0,29 |
| **EuroMASTR PLC** | | | | |
| 0,986 % fällig am 15.06.2040 | | 795 | 766 | 0,18 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,443 % fällig am 12.09.2065 | | 174 | 174 | 0,04 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 1,743 % fällig am 12.09.2068 | £ | 1.258 | £ 1.261 | 0,30 |
| **Gosforth Funding PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 25.08.2060 | | 441 | 441 | 0,10 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,911 % fällig am 18.03.2039 | | 1.543 | 1.515 | 0,36 |
| 0,931 % fällig am 18.06.2038 | | 35 | 35 | 0,01 |
| **Harben Finance PLC** | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | | 78 | 78 | 0,02 |
| **Ludgate Funding PLC** | | | | |
| 1,441 % fällig am 01.01.2061 | | 2.548 | 2.452 | 0,58 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 1,436 % fällig am 15.12.2049 | | 173 | 169 | 0,04 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 0,282 % fällig am 15.12.2050 | € | 1.308 | 1.133 | 0,27 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,061 % fällig am 15.01.2039 | £ | 208 | 197 | 0,05 |
| **Precise Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,443 % fällig am 12.12.2054 | | 162 | 161 | 0,04 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,732 % fällig am 20.12.2046 | | 201 | 202 | 0,05 |
| 1,936 % fällig am 15.06.2046 | | 60 | 60 | 0,01 |
| 1,982 % fällig am 20.09.2065 | | 184 | 185 | 0,04 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | | 156 | 156 | 0,04 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,493 % fällig am 12.06.2046 | | 2.413 | 2.390 | 0,56 |
| 1,763 % fällig am 12.06.2046 | | 1.194 | 1.193 | 0,28 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,457 % fällig am 21.01.2070 | | 400 | 401 | 0,09 |
| **Thrones PLC** | | | | |
| 1,656 % fällig am 15.11.2049 | | 210 | 210 | 0,05 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,654 % fällig am 20.05.2045 | | 675 | 676 | 0,16 |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 1.500 | 1.506 | 0,35 |
| **Trinity Square PLC** | | | | |
| 1,971 % fällig am 15.07.2051 | | 215 | 217 | 0,05 |
| | | | 16.837 | 3,96 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 1,750 % fällig am 07.09.2022 | | 500 | 519 | 0,12 |
| 2,000 % fällig am 07.09.2025 | | 1.200 | 1.298 | 0,31 |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 (i) | | 10.200 | 13.931 | 3,27 |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 (i) | | 7.500 | 10.723 | 2,52 |
| 4,250 % fällig am 07.03.2036 (i) | | 3.700 | 5.361 | 1,26 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2046 | | 2.400 | 3.898 | 0,92 |
| | | | 35.730 | 8,40 |
| Summe Großbritannien | | | 215.695 | 50,71 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | |
| 3,379 % fällig am 25.05.2035 | $ | 329 | 252 | 0,06 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 4,763 % fällig am 25.07.2036 | | 2 | 2 | 0,00 |
| | | | 254 | 0,06 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 300 | 236 | 0,06 |
| **Amazon.com, Inc.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 22.08.2027 | | 1.000 | 827 | 0,19 |
| **American Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.08.2026 | | 200 | 158 | 0,04 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 22.05.2026 | € | 1.200 | 1.148 | 0,27 |
| **American Water Capital Corp.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 01.06.2029 | $ | 1.600 | 1.308 | 0,31 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 13.09.2029 | £ | 2.550 | 2.947 | 0,69 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 15.05.2025 | $ | 1.300 | 1.051 | 0,25 |
| 3,616 % fällig am 12.06.2024 | | 2.300 | 1.831 | 0,43 |
| 4,375 % fällig am 14.09.2029 | £ | 1.200 | 1.381 | 0,32 |
| 5,200 % fällig am 18.11.2033 | £ | 700 | £ 874 | 0,21 |
| 5,500 % fällig am 15.03.2027 | | 700 | 853 | 0,20 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 3,419 % fällig am 20.12.2028 | $ | 1.283 | 1.038 | 0,24 |
| 4,250 % fällig am 10.12.2026 | £ | 650 | 758 | 0,18 |
| 7,000 % fällig am 31.07.2028 | | 250 | 353 | 0,08 |
| 8,125 % fällig am 02.06.2028 | | 300 | 426 | 0,10 |
| **Berkshire Hathaway Finance Corp.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 19.06.2039 | | 2.100 | 2.144 | 0,50 |
| **Boston Properties LP** | | | | |
| 3,400 % fällig am 21.06.2029 | $ | 900 | 725 | 0,17 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2024 | | 100 | 84 | 0,02 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 09.03.2021 | | 100 | 80 | 0,02 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 0,500 % fällig am 29.01.2022 | € | 400 | 363 | 0,08 |
| 1,500 % fällig am 24.07.2026 | | 1.000 | 942 | 0,22 |
| 2,750 % fällig am 24.01.2024 | £ | 1.400 | 1.456 | 0,34 |
| 5,150 % fällig am 21.05.2026 | | 760 | 917 | 0,22 |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.10.2025 | $ | 200 | 170 | 0,04 |
| **Digital Euro Finco LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | € | 600 | 587 | 0,14 |
| **Digital Stout Holding LLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 17.01.2025 | £ | 600 | 663 | 0,16 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 2,500 % fällig am 20.09.2024 | | 1.050 | 1.061 | 0,25 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | $ | 100 | 79 | 0,02 |
| **EMC Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 01.06.2020 | | 100 | 78 | 0,02 |
| **Equinix, Inc.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 15.03.2024 | € | 1.000 | 938 | 0,22 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | | |
| 2,602 % fällig am 21.05.2025 | £ | 1.700 | 1.750 | 0,41 |
| **Fiserv, Inc.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 01.07.2025 (a) | | 1.900 | 1.910 | 0,45 |
| 3,000 % fällig am 01.07.2031 (a) | | 1.191 | 1.211 | 0,28 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | | 1.400 | 1.470 | 0,35 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 07.12.2028 | | 2.300 | 2.695 | 0,63 |
| 5,375 % fällig am 18.12.2040 | | 100 | 122 | 0,03 |
| **GlaxoSmithKline Capital, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 18.03.2043 | $ | 1.000 | 883 | 0,21 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.07.2029 | £ | 1.300 | 1.375 | 0,32 |
| 4,250 % fällig am 29.01.2026 | | 1.200 | 1.342 | 0,32 |
| 7,250 % fällig am 10.04.2028 | | 900 | 1.244 | 0,29 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.02.2027 | $ | 900 | 756 | 0,18 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.09.2024 | | 150 | 120 | 0,03 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | | |
| 4,203 % fällig am 23.07.2029 | | 700 | 602 | 0,14 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.07.2027 | £ | 1.300 | 1.419 | 0,33 |
| **Metropolitan Life Global Funding** | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.06.2022 | | 900 | 907 | 0,21 |
| **MidAmerican Energy Co.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 15.04.2029 | $ | 600 | 509 | 0,12 |
| **Morgan Stanley** | | | | |
| 2,625 % fällig am 09.03.2027 | £ | 950 | 985 | 0,23 |
| **New York Life Global Funding** | | | | |
| 1,625 % fällig am 15.12.2023 | | 1.600 | 1.623 | 0,38 |
| **Physicians Realty LP** | | | | |
| 4,300 % fällig am 15.03.2027 | $ | 100 | 81 | 0,02 |
| **Prologis LP** | | | | |
| 2,250 % fällig am 30.06.2029 | £ | 1.250 | 1.265 | 0,30 |
| **Rabobank Capital Funding Trust** | | | | |
| 5,556 % fällig am 31.12.2019 (e) | | 400 | 408 | 0,10 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 1,339 % fällig am 15.12.2039 | | 1.163 | 1.111 | 0,26 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.07.2042 | | 1.400 | 1.607 | 0,38 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 27.10.2036 | £ | 600 | £ 661 | 0,16 |
| 3,376 % fällig am 15.02.2025 | $ | 21 | 17 | 0,00 |
| 4,016 % fällig am 03.12.2029 | | 137 | 117 | 0,03 |
| 4,400 % fällig am 01.11.2034 | | 1.400 | 1.221 | 0,29 |
| 4,750 % fällig am 17.02.2034 | £ | 550 | 696 | 0,16 |
| **Walmart, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 27.03.2034 | | 400 | 590 | 0,14 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | | |
| 2,000 % fällig am 28.07.2025 | | 3.100 | 3.120 | 0,73 |
| 2,125 % fällig am 20.12.2023 | | 700 | 715 | 0,17 |
| 2,500 % fällig am 02.05.2029 | | 2.100 | 2.162 | 0,51 |
| 4,875 % fällig am 29.11.2035 | | 250 | 316 | 0,07 |
| **Welltower, Inc.** | | | | |
| 4,800 % fällig am 20.11.2028 | | 1.300 | 1.540 | 0,36 |
| | | | 62.026 | 14,58 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 2,904 % fällig am 25.04.2035 | $ | 190 | 144 | 0,03 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | | |
| 3,074 % fällig am 25.07.2035 | | 1.500 | 1.151 | 0,27 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | | |
| 4,042 % fällig am 20.07.2037 ^ | | 15 | 11 | 0,00 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | | |
| 4,566 % fällig am 25.02.2034 | | 4 | 3 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | | |
| 3,704 % fällig am 25.11.2042 | | 31 | 24 | 0,01 |
| | | | 1.333 | 0,31 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | | |
| **Fannie Mae** | | | | |
| 3,682 % fällig am 01.07.2044 | | 12 | 9 | 0,00 |
| 4,665 % fällig am 01.08.2036 | | 17 | 14 | 0,01 |
| | | | 23 | 0,01 |
| Summe USA | | | 63.636 | 14,96 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (k)** | | | | |
| | | | 1.794 | 0,42 |
| **U.K. TREASURY BILLS** | | | | |
| 0,730 % fällig am 12.08.2019 (c)(d)(j) | £ | 638 | 637 | 0,15 |
| 0,730 % fällig am 19.08.2019 (c)(d)(j) | | 325 | 325 | 0,08 |
| | | | 962 | 0,23 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 2.756 | 0,65 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **£ 445.398** | **104,70** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 14 | £ (28) | (0,01) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 28 | (45) | (0,01) |
| Euro-Bobl September Futures | Short | 09/2019 | 39 | (20) | 0,00 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 152 | 313 | 0,07 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 191 | (574) | (0,13) |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09/2019 | 36 | 5 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 168,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 14 | 9 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 168,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 28 | 17 | 0,00 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 120 | 157 | 0,04 |
| | | | | £ (166) | (0,04) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **£ (166)** | **(0,04)** |

[1] Future-Style-Option.

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.06.2023 | $ 1.000 | £ 6 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | 500 | 4 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | 5 | 0,00 |
| Lincoln National Corp. | 1,000 | 20.12.2021 | 900 | (3) | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2024 | € 5.100 | 41 | 0,01 |
| Shell International Finance BV | 1,000 | 20.12.2026 | 800 | 8 | 0,01 |
| Shell International Finance BV | 1,000 | 20.06.2027 | 300 | 4 | 0,00 |
| | | | | £ 65 | 0,02 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 2.300 | £ 11 | 0,00 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 11.700 | 32 | 0,01 |
| | | | | £ 43 | 0,01 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 % | 21.06.2022 | $ 29.000 | £ (558) | (0,14) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 18.12.2024 | 2.200 | (2) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,750 | 19.12.2023 | 4.500 | (134) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 7.400 | (157) | (0,04) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 18.12.2049 | 600 | (5) | 0,00 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.09.2021 | € 10.400 | (54) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2024 | 7.600 | (29) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | 7.900 | (142) | (0,03) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.12.2049 | 500 | (2) | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.09.2021 | £ 65.000 | 413 | 0,10 |
| Zahlung[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2024 | 5.200 | 5 | 0,00 |
| Zahlung[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | 11.300 | 190 | 0,04 |
| Zahlung[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.12.2049 | 8.800 | (81) | (0,02) |
| | | | | | £ (556) | (0,14) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **£ (448)** | **(0,11)** |

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

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

[3] Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des 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 | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Call - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Kauf | 0,500 % | 18.09.2019 | 32.800 | £ (21) | £ (32) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,800 | 18.09.2019 | 32.800 | (17) | (15) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 25.000 | (38) | (6) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 18.09.2019 | 18.000 | (26) | (6) | 0,00 |
| GST | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.300 | (2) | 0 | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 2.000 | (3) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | £ (107) | £ (59) | (0,01) |

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Rio Tinto Finance USA Ltd. | 1,000 % | 20.12.2021 | $ 1.300 | £ (11) | £ 31 | £ 20 | 0,00 |
| JPM | Heathrow Funding Ltd. | 1,000 | 20.06.2024 | € 4.700 | 7 | 26 | 33 | 0,01 |
| | | | | | £ (4) | £ 57 | £ 53 | 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) 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 | 08/2019 | $ 451 | £ 355 | £ 1 | £ 0 | £ 1 | 0,00 |
| BPS | 08/2019 | € 1.422 | 1.261 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ 6.948 | $ 8.816 | 0 | (36) | (36) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ 1.120 | £ 878 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| CBK | 08/2019 | £ 601 | $ 765 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| HUS | 08/2019 | $ 653 | £ 518 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| JPM | 08/2019 | 61.671 | 47.140 | 0 | (1.217) | (1.217) | (0,27) |
| RYL | 08/2019 | € 1.074 | 963 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ 712 | $ 910 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 3.157 | £ 2.435 | 0 | (41) | (41) | (0,01) |
| SCX | 08/2019 | € 41.694 | 36.099 | 0 | (1.263) | (1.263) | (0,30) |
| SSB | 08/2019 | 2.355 | 2.087 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| | | | | £ 9 | £ (2.594) | £ (2.585) | (0,60) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **£ (2.591)** | **(0,60)** |
| **Summe Anlagen** | **£ 442.193** | **103,95** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **£ (16.802)** | **(3,95)** |
| **Nettovermögen** | **£ 425.391** | **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) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(h) Eingeschränkte Wertpapiere:**

| Emittentenbeschreibung | Kupon | Fälligkeitsdatum | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Thames Water Utilities Finance PLC | 5,050 % | 30.06.2020 | 19.10.2017 | £ 1.242 | £ 1.241 | 0,29 |

**(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 28.628 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von GBP 1.171 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von GBP 6.268 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**(j) Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 962 und Barmittel in Höhe von GBP 1.690 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(k) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 0,730 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | £ 1.400 | United Kingdom Gilt 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ (1.397) | £ 1.400 | £ 1.400 | 0,33 |
| FICC | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 501 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | (402) | 394 | 394 | 0,09 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **£ (1.799)** | **£ 1.794** | **£ 1.794** | **0,42** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 30.655 | £ 414.743 | £ 0 | £ 445.398 |
| Finanzderivate[3] | (166) | (3.039) | 0 | (3.205) |
| **Summen** | **£ 30.489** | **£ 411.704** | **£ 0** | **£ 442.193** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 36.687 | £ 369.873 | £ 0 | £ 406.560 |
| Finanzderivate[3] | 136 | (1.455) | 0 | (1.319) |
| **Summen** | **£ 36.823** | **£ 368.418** | **£ 0** | **£ 405.241** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

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

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

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| CFR | (3,000) % | 12.06.2019 | TBD[1] | £ (325) | £ (325) | (0,08) |
| SCX | 0,890 | 10.04.2019 | 08.08.2019 | (27.563) | (27.619) | (6,49) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **£ (27.944)** | **(6,57)** |

(1) Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | £ 1 | £ 0 | £ 1 |
| BPS | (96) | 0 | (96) |
| BRC | (6) | 0 | (6) |
| CBK | (1) | 0 | (1) |
| CKL | (6) | 0 | (6) |
| GST | 20 | 0 | 20 |
| HUS | 6 | 0 | 6 |

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| JPM | £ (1.184) | £ 1.282 | £ 98 |
| RYL | (39) | 0 | (39) |
| SCX | (1.263) | 1.370 | 107 |
| SSB | (23) | 0 | (23) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 102,23 | 96,19 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 2,05 | 8,81 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,42 | 0,08 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,04) | 0,03 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,11) | 0,00 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,60) | (0,37) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (6,57) | (7,07) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 0,82 | 1,39 |
| Österreich | 0,24 | 0,00 |
| Belgien | 0,81 | 0,75 |
| Brasilien | 0,29 | 0,00 |
| Kanada | 0,92 | 0,98 |
| Cayman-Inseln | 0,73 | 0,97 |
| Dänemark | 0,53 | 0,45 |
| Finnland | 0,07 | 0,07 |
| Frankreich | 5,46 | 3,72 |
| Deutschland | 1,75 | 1,90 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,58 | 0,50 |
| Irland | 8,94 | 11,16 |
| Italien | 0,62 | 0,44 |
| Japan | 0,21 | 0,19 |
| Jersey, Kanalinseln | 3,16 | 2,46 |
| Luxemburg | 2,36 | 1,84 |
| Niederlande | 5,57 | 6,61 |
| Singapur | 0,65 | 0,67 |
| Slowakei | 0,07 | 0,07 |
| Spanien | 0,88 | 0,21 |
| Supranational | 2,54 | 4,27 |
| Schweden | 0,04 | 0,08 |
| Schweiz | 1,14 | 1,07 |
| Großbritannien | 50,71 | 47,34 |
| Vereinigte Staaten | 14,96 | 10,40 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,65 | 7,54 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | (0,04) | 0,03 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,02 | (0,01) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,01 | (0,03) |
| Zinsswaps | (0,14) | 0,04 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Geschriebene Optionen Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,01) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,01 | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | (0,60) | (0,37) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (3,95) | (4,74) |
| | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **APT Pipelines Ltd.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 22.03.2030 | £ | 900 | £ | 977 | 0,23 |
| **BHP Billiton Finance Ltd.** | | | | | |
| 4,300 % fällig am 25.09.2042 | | 1.300 | | 1.737 | 0,41 |
| **BHP Billiton Finance USA Ltd.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 30.09.2043 | $ | 1.400 | | 1.380 | 0,33 |
| **Westfield America Management Ltd.** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 30.03.2025 | £ | 300 | | 302 | 0,07 |
| 2,625 % fällig am 30.03.2029 | | 1.050 | | 1.082 | 0,25 |
| Summe Australien | | | | 5.478 | 1,29 |
| **ÖSTERREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **IMMOFINANZ AG** | | | | | |
| 2,625 % fällig am 27.01.2023 | € | 1.400 | | 1.310 | 0,31 |
| **BELGIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **KBC Group NV** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 05.03.2024 (c)(e) | | 200 | | 190 | 0,04 |
| **BERMUDA** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Hiscox Ltd.** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 24.11.2045 | £ | 1.300 | | 1.453 | 0,34 |
| **BRASILIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.10.2029 | | 300 | | 313 | 0,07 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Dwr Cymru Financing Ltd.** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 31.03.2036 | | 1.000 | | 1.063 | 0,25 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | | |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | $ | 900 | | 709 | 0,17 |
| **Trafford Centre Finance Ltd.** | | | | | |
| 1,544 % fällig am 28.07.2038 | £ | 1.350 | | 1.213 | 0,28 |
| 6,500 % fällig am 28.07.2033 | | 470 | | 636 | 0,15 |
| 7,030 % fällig am 28.01.2029 | | 1.301 | | 1.606 | 0,38 |
| Summe Cayman Inseln | | | | 5.227 | 1,23 |
| **DÄNEMARK** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Danske Bank A/S** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 06.04.2022 (c)(e) | € | 700 | | 663 | 0,16 |
| **Orsted A/S** | | | | | |
| 2,500 % fällig am 16.05.2033 | £ | 2.200 | | 2.286 | 0,54 |
| 4,875 % fällig am 12.01.2032 | | 1.000 | | 1.294 | 0,30 |
| Summe Dänemark | | | | 4.243 | 1,00 |
| **FINNLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Ahlstrom-Munksjo Oyj** | | | | | |
| 1,875 % fällig am 09.06.2022 | € | 100 | | 91 | 0,02 |
| **FRANKREICH** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AXA S.A.** | | | | | |
| 5,453 % fällig am 04.03.2026 (c) | £ | 1.900 | | 2.106 | 0,49 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 23.01.2026 | | 400 | | 425 | 0,10 |
| **BPCE S.A.** | | | | | |
| 0,625 % fällig am 26.09.2023 | € | 200 | | 183 | 0,04 |
| 5,250 % fällig am 16.04.2029 | £ | 1.000 | | 1.195 | 0,28 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | | |
| 7,500 % fällig am 23.06.2026 (c)(e) | | 300 | | 341 | 0,08 |
| **Electricite de France S.A.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 21.09.2048 | $ | 1.300 | £ | 1.165 | 0,27 |
| 5,125 % fällig am 22.09.2050 | £ | 1.500 | | 2.150 | 0,50 |
| 5,500 % fällig am 27.03.2037 | | 5.600 | | 7.775 | 1,83 |
| 5,500 % fällig am 17.10.2041 | | 2.000 | | 2.882 | 0,68 |
| 6,000 % fällig am 22.01.2114 | $ | 1.900 | | 1.733 | 0,41 |
| 6,125 % fällig am 02.06.2034 | £ | 700 | | 1.005 | 0,24 |
| **Engie S.A.** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2060 | | 500 | | 806 | 0,19 |
| **Orange S.A.** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 06.02.2044 | $ | 1.500 | | 1.469 | 0,34 |
| 5,625 % fällig am 23.01.2034 | £ | 1.100 | | 1.517 | 0,36 |
| **Veolia Environnement S.A.** | | | | | |
| 6,125 % fällig am 29.10.2037 | | 500 | | 763 | 0,18 |
| | | | | 25.515 | 5,99 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **SNCF Reseau** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 11.03.2052 | | 500 | | 824 | 0,19 |
| 5,250 % fällig am 31.01.2035 | | 100 | | 145 | 0,04 |
| | | | | 969 | 0,23 |
| Summe Frankreich | | | | 26.484 | 6,22 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Deutsche Bank AG** | | | | | |
| 3,875 % fällig am 12.02.2024 | | 1.300 | | 1.334 | 0,32 |
| **Deutsche Telekom AG** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 06.02.2034 | | 600 | | 637 | 0,15 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % bar oder 4,375 % PIK)** | | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.05.2025 (b) | € | 800 | | 733 | 0,17 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % bar oder 4,500 % PIK)** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.09.2026 (b) | | 100 | | 91 | 0,02 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 07.06.2032 | £ | 400 | | 609 | 0,14 |
| **TLG Immobilien AG** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 28.05.2026 | € | 600 | | 537 | 0,13 |
| Summe Deutschland | | | | 3.941 | 0,93 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 26.03.2025 | $ | 850 | | 698 | 0,16 |
| 3,800 % fällig am 09.06.2023 | | 250 | | 204 | 0,05 |
| | | | | 902 | 0,21 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **States of Guernsey Bond** | | | | | |
| 3,375 % fällig am 12.12.2046 | £ | 1.000 | | 1.207 | 0,29 |
| Summe Guernsey, Kanalinseln | | | | 2.109 | 0,50 |
| **HONGKONG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | | | |
| 4,071 % fällig am 25.05.2023 | $ | 200 | | 157 | 0,04 |
| **IRLAND** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Bank of Ireland** | | | | | |
| 7,375 % fällig am 18.06.2020 (c)(e) | € | 600 | | 568 | 0,13 |
| **ESB Finance DAC** | | | | | |
| 1,125 % fällig am 11.06.2030 | | 300 | | 277 | 0,07 |
| **GE Capital UK Funding Unlimited Co.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 13.09.2023 | £ | 500 | | 540 | 0,13 |
| 5,875 % fällig am 04.11.2020 | | 1.300 | | 1.374 | 0,32 |
| 5,875 % fällig am 18.01.2033 | | 4.600 | | 5.716 | 1,34 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | $ | 200 | | 159 | 0,04 |
| | | | | 8.634 | 2,03 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (d)** | | 13.500 | £ | 1.211 | 0,28 |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (d)** | | 111.000 | | 11.351 | 2,67 |
| | | | | 12.562 | 2,95 |
| Summe Irland | | | | 21.196 | 4,98 |
| | | **PARI (000S)** | | | |
| **ITALIEN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **UniCredit SpA** | | | | | |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ | 1.600 | | 1.437 | 0,34 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | | |
| **Italy Government International Bond** | | | | | |
| 6,000 % fällig am 04.08.2028 | £ | 1.100 | | 1.296 | 0,30 |
| Summe Italien | | | | 2.733 | 0,64 |
| **JAPAN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **East Japan Railway Co.** | | | | | |
| 4,500 % fällig am 25.01.2036 | | 300 | | 406 | 0,09 |
| **JERSEY, KANALINSELN** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **AA Bond Co. Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 31.07.2043 | | 1.600 | | 1.465 | 0,34 |
| 2,875 % fällig am 31.07.2043 | | 900 | | 859 | 0,20 |
| 4,249 % fällig am 31.07.2043 | | 337 | | 343 | 0,08 |
| 4,875 % fällig am 31.07.2043 | | 1.400 | | 1.381 | 0,33 |
| **Atrium European Real Estate Ltd.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 11.09.2025 | € | 200 | | 193 | 0,05 |
| **Gatwick Funding Ltd.** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 28.09.2041 | £ | 800 | | 834 | 0,20 |
| **Heathrow Funding Ltd.** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 09.08.2051 | | 700 | | 691 | 0,16 |
| 4,625 % fällig am 31.10.2046 | | 400 | | 536 | 0,13 |
| 5,875 % fällig am 13.05.2043 | | 400 | | 603 | 0,14 |
| 6,450 % fällig am 10.12.2031 | | 1.340 | | 1.949 | 0,46 |
| **HSBC Bank Capital Funding Sterling LP** | | | | | |
| 5,844 % fällig am 05.11.2031 (c) | | 1.163 | | 1.504 | 0,35 |
| **Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.** | | | | | |
| 3,950 % fällig am 30.06.2022 | | 3.250 | | 3.329 | 0,78 |
| Summe Jersey, Kanalinseln | | | | 13.687 | 3,22 |
| **LUXEMBURG** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Aroundtown S.A.** | | | | | |
| 3,000 % fällig am 16.10.2029 | | 1.900 | | 1.851 | 0,43 |
| 3,250 % fällig am 18.07.2027 | | 1.000 | | 1.008 | 0,24 |
| 3,625 % fällig am 10.04.2031 | | 200 | | 201 | 0,05 |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 2.200 | | 1.871 | 0,44 |
| **Logicor Financing SARL** | | | | | |
| 1,500 % fällig am 14.11.2022 | € | 900 | | 834 | 0,19 |
| 2,250 % fällig am 13.05.2025 | | 700 | | 669 | 0,16 |
| Summe Luxemburg | | | | 6.434 | 1,51 |
| **NIEDERLANDE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | | |
| 4,625 % fällig am 23.05.2029 | £ | 300 | | 348 | 0,08 |
| 5,250 % fällig am 14.09.2027 | | 1.100 | | 1.307 | 0,31 |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (c)(e) | € | 200 | | 187 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 29.06.2021 (c)(e) | | 800 | | 794 | 0,19 |
| 6,910 % fällig am 10.06.2038 (c) | £ | 850 | | 1.231 | 0,29 |
| **E.ON International Finance BV** | | | | | |
| 5,875 % fällig am 30.10.2037 | | 2.000 | | 2.868 | 0,67 |
| 6,375 % fällig am 07.06.2032 | | 1.115 | | 1.585 | 0,37 |
| 6,650 % fällig am 30.04.2038 | $ | 200 | | 203 | 0,05 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 14.09.2040 | £ | 3.200 | £ 4.387 | 1,03 |
| **ING Bank NV** | | | | |
| 5,800 % fällig am 25.09.2023 | $ | 200 | 174 | 0,04 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 15.11.2030 | € | 200 | 206 | 0,05 |
| **innogy Finance BV** | | | | |
| 4,750 % fällig am 31.01.2034 | £ | 6.600 | 8.229 | 1,93 |
| 6,125 % fällig am 06.07.2039 | | 1.250 | 1.865 | 0,44 |
| **JAB Holdings BV** | | | | |
| 2,500 % fällig am 25.06.2029 | € | 400 | 393 | 0,09 |
| **Koninklijke KPN NV** | | | | |
| 5,750 % fällig am 17.09.2029 | £ | 200 | 233 | 0,06 |
| **LafargeHolcim Sterling Finance Netherlands BV** | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.05.2032 | | 500 | 507 | 0,12 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | | |
| 1,375 % fällig am 07.03.2024 | € | 100 | 92 | 0,02 |
| **Nederlandse Waterschapsbank NV** | | | | |
| 5,375 % fällig am 07.06.2032 | £ | 500 | 725 | 0,17 |
| **NN Group NV** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2026 (c) | € | 1.000 | 990 | 0,23 |
| 4,625 % fällig am 13.01.2048 | | 700 | 720 | 0,17 |
| **Stichting AK Rabobank Certificaten** | | | | |
| 6,500 % fällig am 29.12.2049 (c) | | 1.600 | 1.756 | 0,41 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | | |
| 2,750 % fällig am 10.07.2023 | £ | 1.100 | 1.127 | 0,27 |
| Summe Niederlande | | | 29.927 | 7,03 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Equinor ASA** | | | | |
| 6,875 % fällig am 11.03.2031 | | 100 | 155 | 0,04 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Temasek Financial Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 26.07.2040 | | 1.950 | 2.980 | 0,70 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 1,000 % fällig am 21.06.2026 | € | 200 | 182 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (c)(e) | | 200 | 185 | 0,04 |
| 6,750 % fällig am 18.02.2020 (c)(e) | | 600 | 553 | 0,13 |
| 8,875 % fällig am 14.04.2021 (c)(e) | | 200 | 200 | 0,05 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 11.09.2021 (c)(e) | | 100 | 94 | 0,02 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | | |
| 5,445 % fällig am 08.10.2029 | £ | 600 | 761 | 0,18 |
| Summe Spanien | | | 1.975 | 0,46 |
| **SUPRANATIONAL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Europäische Investitionsbank** | | | | |
| 3,875 % fällig am 08.06.2037 | | 300 | 408 | 0,10 |
| 5,625 % fällig am 07.06.2032 | | 3.300 | 4.929 | 1,16 |
| 6,000 % fällig am 07.12.2028 (f) | | 10.500 | 14.956 | 3,51 |
| Summe übernational | | | 20.293 | 4,77 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Investor AB** | | | | |
| 5,500 % fällig am 05.05.2037 | | 400 | 589 | 0,14 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 5,750 % fällig am 18.09.2025 (e) | € | 100 | 95 | 0,02 |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (e) | $ | 400 | 346 | 0,08 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 1,000 % fällig am 24.06.2027 | € | 400 | 363 | 0,08 |
| 2,125 % fällig am 12.09.2025 | £ | 200 | 199 | 0,05 |
| 3,869 % fällig am 12.01.2029 | $ | 250 | 203 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (c)(e) | | 600 | 504 | 0,12 |
| **UBS AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2024 (e) | $ | 900 | £ 752 | 0,17 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (e) | | 2.350 | 2.072 | 0,49 |
| Summe Schweiz | | | 4.534 | 1,06 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ABP Finance PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 14.12.2026 | £ | 100 | 123 | 0,03 |
| **Affinity Sutton Capital Markets PLC** | | | | |
| 5,981 % fällig am 17.09.2038 | | 200 | 303 | 0,07 |
| **Anglian Water Services Financing PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 26.10.2029 | | 1.700 | 1.825 | 0,43 |
| **Annington Funding PLC** | | | | |
| 3,685 % fällig am 12.07.2034 | | 1.900 | 2.019 | 0,47 |
| 3,935 % fällig am 12.07.2047 | | 1.300 | 1.398 | 0,33 |
| **Arqiva Financing PLC** | | | | |
| 4,882 % fällig am 31.12.2032 | | 1.181 | 1.343 | 0,32 |
| 5,340 % fällig am 30.12.2037 | | 700 | 843 | 0,20 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (e) | $ | 2.700 | 2.318 | 0,54 |
| 10,000 % fällig am 21.05.2021 | £ | 750 | 863 | 0,20 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 06.10.2023 | | 600 | 601 | 0,14 |
| 3,125 % fällig am 17.01.2024 | | 500 | 515 | 0,12 |
| 3,250 % fällig am 17.01.2033 | | 700 | 684 | 0,16 |
| 6,500 % fällig am 15.09.2019 (c)(e) | € | 200 | 181 | 0,04 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2025 (c)(e) | £ | 400 | 419 | 0,10 |
| 7,250 % fällig am 15.03.2023 (c)(e) | | 400 | 418 | 0,10 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (c) | | 300 | 318 | 0,07 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (c)(e) | | 1.425 | 1.513 | 0,36 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (c)(e) | € | 1.200 | 1.164 | 0,27 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (c)(e) | $ | 1.900 | 1.567 | 0,37 |
| **BPHA Finance PLC** | | | | |
| 4,816 % fällig am 11.04.2044 | £ | 595 | 803 | 0,19 |
| **British Land Co. PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.09.2029 | | 1.200 | 1.201 | 0,28 |
| **British Telecommunications PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 21.11.2031 | | 1.800 | 1.894 | 0,44 |
| 6,375 % fällig am 23.06.2037 | | 100 | 144 | 0,03 |
| **Broadgate Financing PLC** | | | | |
| 4,999 % fällig am 05.10.2033 | | 600 | 734 | 0,17 |
| 5,098 % fällig am 05.04.2035 | | 93 | 111 | 0,03 |
| **Cadent Finance PLC** | | | | |
| 2,125 % fällig am 22.09.2028 | | 550 | 548 | 0,13 |
| 2,625 % fällig am 22.09.2038 | | 1.000 | 988 | 0,23 |
| 2,750 % fällig am 22.09.2046 | | 4.300 | 4.212 | 0,99 |
| **Catalyst Housing Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 31.10.2047 | | 1.000 | 1.065 | 0,25 |
| **Centrica PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 12.09.2044 | | 1.100 | 1.283 | 0,30 |
| **Clarion Funding PLC** | | | | |
| 3,125 % fällig am 19.04.2048 | | 3.500 | 3.744 | 0,88 |
| **Compass Group PLC** | | | | |
| 2,000 % fällig am 03.07.2029 | | 600 | 623 | 0,15 |
| **Connect Plus M25 Issuer PLC** | | | | |
| 2,607 % fällig am 31.03.2039 | | 1.082 | 1.168 | 0,27 |
| **CYBG PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 25.09.2026 | | 500 | 504 | 0,12 |
| 7,875 % fällig am 14.12.2028 | | 500 | 538 | 0,13 |
| **Drax Finco PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.05.2022 | | 700 | 715 | 0,17 |
| 6,625 % fällig am 01.11.2025 | $ | 200 | 161 | 0,04 |
| **DS Smith PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 26.07.2029 | £ | 500 | 506 | 0,12 |
| **EI Group PLC** | | | | |
| 6,375 % fällig am 26.09.2031 | | 233 | 254 | 0,06 |
| **EMH Treasury PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 29.01.2044 | | 1.150 | 1.488 | 0,35 |
| **Eversholt Funding PLC** | | | | |
| 3,529 % fällig am 07.08.2042 | | 1.000 | 1.007 | 0,24 |
| **Frontier Finance PLC** | | | | |
| 8,000 % fällig am 23.03.2022 | | 2.800 | 2.926 | 0,69 |
| **Futures Treasury PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 08.02.2044 | | 700 | 783 | 0,18 |
| **GlaxoSmithKline Capital PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2045 | £ | 700 | £ 921 | 0,22 |
| 5,250 % fällig am 19.12.2033 | | 1.400 | 1.937 | 0,45 |
| 5,250 % fällig am 10.04.2042 | | 100 | 146 | 0,03 |
| 6,375 % fällig am 09.03.2039 | | 500 | 800 | 0,19 |
| **Grainger PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2028 | | 500 | 517 | 0,12 |
| **Great Places Housing Group Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.10.2042 | | 600 | 796 | 0,19 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 2,866 % fällig am 15.03.2036 | | 600 | 482 | 0,11 |
| 3,286 % fällig am 15.12.2033 | | 409 | 412 | 0,10 |
| 3,593 % fällig am 15.03.2035 | | 500 | 519 | 0,12 |
| 4,064 % fällig am 15.03.2035 | | 261 | 282 | 0,07 |
| 5,106 % fällig am 15.03.2034 | | 2.224 | 2.580 | 0,61 |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | | 2.649 | 3.080 | 0,72 |
| **Guinness Partnership Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 24.10.2044 | | 700 | 864 | 0,20 |
| **Hammerson PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 27.10.2025 | | 200 | 206 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 23.02.2026 | | 300 | 351 | 0,08 |
| **Heathrow Finance PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.03.2027 | | 100 | 98 | 0,02 |
| **High Speed Rail Finance PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.11.2038 | | 1.600 | 2.026 | 0,48 |
| **Home Group Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 27.03.2043 | | 1.300 | 1.328 | 0,31 |
| **HSBC Bank PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 24.03.2046 | | 3.750 | 4.575 | 1,07 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 16.08.2028 | | 1.100 | 1.126 | 0,26 |
| 3,000 % fällig am 22.07.2028 | | 600 | 626 | 0,15 |
| 3,000 % fällig am 29.05.2030 | | 3.200 | 3.295 | 0,77 |
| 5,750 % fällig am 20.12.2027 | | 600 | 727 | 0,17 |
| 5,875 % fällig am 28.09.2026 (c)(e) | | 400 | 421 | 0,10 |
| 6,000 % fällig am 29.09.2023 (c)(e) | € | 300 | 310 | 0,07 |
| 7,000 % fällig am 07.04.2038 | £ | 300 | 433 | 0,10 |
| **John Lewis PLC** | | | | |
| 4,250 % fällig am 18.12.2034 | | 1.222 | 1.142 | 0,27 |
| 6,125 % fällig am 21.01.2025 | | 700 | 789 | 0,18 |
| **Juturna European Loan Conduit PLC** | | | | |
| 5,064 % fällig am 10.08.2033 | | 1.167 | 1.462 | 0,34 |
| **Karbon Homes Ltd.** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.11.2047 | | 900 | 1.024 | 0,24 |
| **Land Securities Capital Markets PLC** | | | | |
| 2,399 % fällig am 08.02.2031 | | 800 | 837 | 0,20 |
| 2,625 % fällig am 22.09.2039 | | 1.500 | 1.546 | 0,36 |
| **LCR Finance PLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 07.12.2038 | | 75 | 111 | 0,03 |
| **Legal & General Group PLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 27.06.2064 | | 1.800 | 2.032 | 0,48 |
| **Liberty Living Finance PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 28.11.2029 | | 1.100 | 1.145 | 0,27 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 30.03.2027 | | 2.700 | 3.366 | 0,79 |
| 5,125 % fällig am 07.03.2025 | | 200 | 241 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 08.02.2029 | | 1.200 | 1.666 | 0,39 |
| 6,500 % fällig am 17.09.2040 | | 100 | 164 | 0,04 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 2,250 % fällig am 16.10.2024 | | 1.000 | 1.005 | 0,24 |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (c)(e) | | 1.000 | 1.091 | 0,26 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (c)(e) | | 200 | 227 | 0,05 |
| **London & Quadrant Housing Trust Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 28.02.2053 | | 1.100 | 1.120 | 0,26 |
| **London Power Networks PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 07.06.2027 | | 100 | 130 | 0,03 |
| **Longstone Finance PLC** | | | | |
| 4,896 % fällig am 19.04.2036 | | 100 | 117 | 0,03 |
| **Manchester Airport Group Funding PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 31.03.2039 | | 400 | 411 | 0,10 |
| 2,875 % fällig am 30.09.2044 | | 1.600 | 1.622 | 0,38 |
| **Marks & Spencer PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 12.06.2025 | | 1.500 | 1.634 | 0,38 |
| **Meadowhall Finance PLC** | | | | |
| 4,988 % fällig am 12.07.2037 | | 70 | 88 | 0,02 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 2,661 % fällig am 15.09.2034 | | 993 | 770 | 0,18 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| 2,860 % fällig am 15.12.2030 | $ | 868 | £ 637 | 0,15 |
| 5,965 % fällig am 15.12.2025 | £ | 202 | 217 | 0,05 |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | | 558 | 635 | 0,15 |
| 6,469 % fällig am 15.09.2032 | | 1.832 | 2.073 | 0,49 |
| **Motability Operations Group PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 14.03.2032 | | 1.300 | 1.342 | 0,31 |
| 3,625 % fällig am 10.03.2036 | | 1.000 | 1.186 | 0,28 |
| 5,625 % fällig am 29.11.2030 | | 400 | 551 | 0,13 |
| **National Grid Electricity Transmission PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 06.02.2035 | | 1.800 | 1.937 | 0,45 |
| **Network Rail Infrastructure Finance PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 29.11.2035 (f) | | 1.800 | 2.641 | 0,62 |
| **Next Group PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 18.05.2028 | | 500 | 522 | 0,12 |
| **Northern Electric Finance PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 24.05.2049 | | 1.200 | 1.254 | 0,29 |
| **Northern Gas Networks Finance PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 23.03.2040 | | 106 | 156 | 0,04 |
| **Northern Powergrid Yorkshire PLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 04.05.2035 | | 610 | 837 | 0,20 |
| **Notting Hill Housing Trust** | | | | |
| 3,250 % fällig am 12.10.2048 | | 1.100 | 1.124 | 0,26 |
| **Pacific Quay Finance PLC** | | | | |
| 5,565 % fällig am 25.07.2034 | | 889 | 1.137 | 0,27 |
| **Peabody Capital PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 14.09.2048 | | 1.200 | 1.276 | 0,30 |
| **Places for People Homes Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 22.11.2028 | | 2.400 | 2.525 | 0,59 |
| 5,875 % fällig am 23.05.2031 | | 800 | 1.018 | 0,24 |
| **Prudential PLC** | | | | |
| 5,560 % fällig am 20.07.2055 | | 1.900 | 2.035 | 0,48 |
| 6,125 % fällig am 19.12.2031 | | 100 | 135 | 0,03 |
| **Quadgas Finance PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 17.09.2029 | | 1.000 | 1.018 | 0,24 |
| **RHP Finance PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 05.02.2048 | | 800 | 862 | 0,20 |
| **Rio Tinto Finance PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 11.12.2029 | | 700 | 846 | 0,20 |
| **Riverside Finance PLC** | | | | |
| 3,875 % fällig am 05.12.2044 | | 2.000 | 2.410 | 0,57 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 19.09.2026 | | 700 | 709 | 0,17 |
| 3,125 % fällig am 28.03.2027 | | 1.300 | 1.324 | 0,31 |
| 3,498 % fällig am 15.05.2023 | $ | 700 | 556 | 0,13 |
| 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 600 | 491 | 0,11 |
| 4,800 % fällig am 05.04.2026 | | 1.300 | 1.094 | 0,26 |
| 5,076 % fällig am 27.01.2030 | | 400 | 341 | 0,08 |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (c)(e) | | 200 | 161 | 0,04 |
| 8,625 % fällig am 15.08.2021 (c)(e) | | 1.100 | 934 | 0,22 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2025 | | 1.700 | 1.389 | 0,33 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (c)(e) | £ | 850 | 905 | 0,21 |
| **Santander UK PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 02.03.2026 | | 1.000 | 1.285 | 0,30 |
| 6,500 % fällig am 21.10.2030 | | 100 | 129 | 0,03 |
| **Severn Trent Utilities Finance PLC** | | | | |
| 2,750 % fällig am 05.12.2031 | | 1.000 | 1.064 | 0,25 |
| 4,875 % fällig am 24.01.2042 | | 900 | 1.236 | 0,29 |
| 6,250 % fällig am 07.06.2029 | | 523 | 720 | 0,17 |
| **Shop Direct Funding PLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.11.2022 | | 400 | 372 | 0,09 |
| **Sky Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 26.11.2029 | | 1.200 | 1.436 | 0,34 |
| **Society of Lloyd's** | | | | |
| 4,750 % fällig am 30.10.2024 | | 1.100 | 1.217 | 0,29 |
| **South Eastern Power Networks PLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 30.09.2030 | | 932 | 1.242 | 0,29 |
| 6,375 % fällig am 12.11.2031 | | 100 | 144 | 0,03 |
| **Southern Electric Power Distribution PLC** | | | | |
| 4,625 % fällig am 20.02.2037 | | 1.000 | 1.263 | 0,30 |
| 5,500 % fällig am 07.06.2032 | | 800 | 1.068 | 0,25 |
| **Southern Gas Networks PLC** | | | | |
| 3,100 % fällig am 15.09.2036 | | 1.000 | 1.082 | 0,25 |
| 4,875 % fällig am 21.03.2029 | | 1.369 | 1.714 | 0,40 |
| **Southern Housing Group Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 19.10.2047 | | 1.600 | 1.791 | 0,42 |
| **Spirit Issuer PLC** | | | | |
| 3,474 % fällig am 28.12.2031 | £ | 1.140 | £ 1.131 | 0,27 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | |
| 0,900 % fällig am 02.07.2027 (a) | € | 800 | 718 | 0,17 |
| **Telereal Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,010 % fällig am 10.12.2033 | £ | 1.728 | 1.884 | 0,44 |
| **Telereal Securitisation PLC** | | | | |
| 4,090 % fällig am 10.12.2033 | | 400 | 415 | 0,10 |
| 5,565 % fällig am 10.12.2033 | | 706 | 842 | 0,20 |
| 5,948 % fällig am 10.12.2033 | | 1.211 | 1.501 | 0,35 |
| **Tesco Corporate Treasury Services PLC** | | | | |
| 1,375 % fällig am 24.10.2023 | € | 700 | 649 | 0,15 |
| 2,500 % fällig am 02.05.2025 | £ | 400 | 410 | 0,10 |
| **Tesco PLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 24.02.2022 | | 50 | 56 | 0,01 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | | |
| 5,411 % fällig am 13.07.2044 | | 384 | 491 | 0,12 |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | | 590 | 762 | 0,18 |
| 5,744 % fällig am 13.04.2040 | | 1.995 | 2.609 | 0,61 |
| 5,801 % fällig am 13.10.2040 | | 683 | 904 | 0,21 |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | | 3.547 | 4.676 | 1,10 |
| **Thames Water Utilities Finance PLC** | | | | |
| 2,625 % fällig am 24.01.2032 | | 1.600 | 1.601 | 0,38 |
| 3,500 % fällig am 25.02.2028 | | 200 | 218 | 0,05 |
| 4,375 % fällig am 03.07.2034 | | 600 | 719 | 0,17 |
| 5,500 % fällig am 11.02.2041 | | 200 | 279 | 0,07 |
| **TP ICAP PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 26.01.2024 | | 800 | 837 | 0,20 |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 800 | 820 | 0,19 |
| **Travis Perkins PLC** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.09.2021 | | 1.750 | 1.814 | 0,43 |
| 4,500 % fällig am 07.09.2023 | | 200 | 206 | 0,05 |
| **Unique Pub Finance Co. PLC** | | | | |
| 5,659 % fällig am 30.06.2027 | | 3.932 | 4.420 | 1,04 |
| 7,395 % fällig am 28.03.2024 | | 1.050 | 1.186 | 0,28 |
| **UNITE Group PLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.10.2028 | | 1.100 | 1.156 | 0,27 |
| **University of Oxford** | | | | |
| 2,544 % fällig am 08.12.2117 | | 1.800 | 1.912 | 0,45 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2027 | | 200 | 206 | 0,05 |
| **Virgin Money Holdings UK PLC** | | | | |
| 3,375 % fällig am 24.04.2026 | | 1.000 | 1.010 | 0,24 |
| 8,750 % fällig am 10.11.2021 (c)(e) | | 700 | 754 | 0,18 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.08.2056 | | 1.100 | 981 | 0,23 |
| 3,375 % fällig am 08.08.2049 | | 2.200 | 2.119 | 0,50 |
| 7,000 % fällig am 04.04.2079 | $ | 150 | 127 | 0,03 |
| **Wellcome Trust Ltd.** | | | | |
| 2,517 % fällig am 07.02.2118 | £ | 600 | 625 | 0,15 |
| **Western Power Distribution East Midlands PLC** | | | | |
| 6,250 % fällig am 10.12.2040 | | 950 | 1.486 | 0,35 |
| **Western Power Distribution South Wales PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 23.03.2040 | | 1.600 | 2.354 | 0,55 |
| **Western Power Distribution South West PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 23.03.2040 | | 200 | 294 | 0,07 |
| **Western Power Distribution West Midlands PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 16.04.2032 | | 300 | 410 | 0,10 |
| **WM Treasury PLC** | | | | |
| 3,250 % fällig am 20.10.2048 | | 1.100 | 1.186 | 0,28 |
| **WPP Finance** | | | | |
| 2,875 % fällig am 14.09.2046 | | 700 | 594 | 0,14 |
| **Yorkshire Water Finance PLC** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.08.2029 | | 200 | 229 | 0,05 |
| | | | 195.045 | 45,83 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Canary Wharf Finance PLC** | | | | |
| 6,800 % fällig am 22.10.2033 | | 118 | 154 | 0,04 |
| **Clavis Securities PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 15.12.2032 | € | 105 | 91 | 0,02 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | |
| 1,443 % fällig am 12.09.2065 | £ | 92 | 92 | 0,02 |
| 1,743 % fällig am 12.09.2068 | | 1.064 | 1.067 | 0,25 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | |
| 0,000 % fällig am 18.06.2038 | € | 35 | 31 | 0,01 |
| 0,911 % fällig am 18.03.2039 | £ | 28 | 28 | 0,01 |
| **Mansard Mortgages PLC** | | | | |
| 1,436 % fällig am 15.12.2049 | £ | 274 | £ 268 | 0,06 |
| **Newgate Funding PLC** | | | | |
| 0,282 % fällig am 15.12.2050 | € | 2.042 | 1.768 | 0,42 |
| 0,953 % fällig am 01.12.2050 | £ | 96 | 91 | 0,02 |
| **Oncilla Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 2,193 % fällig am 12.12.2043 | | 111 | 112 | 0,03 |
| **Paragon Mortgages PLC** | | | | |
| 1,061 % fällig am 15.01.2039 | | 2.290 | 2.173 | 0,51 |
| **Residential Mortgage Securities PLC** | | | | |
| 1,936 % fällig am 15.06.2046 | | 60 | 60 | 0,01 |
| **RMAC PLC** | | | | |
| 1,493 % fällig am 12.06.2046 | | 1.293 | 1.281 | 0,30 |
| **Silverstone Master Issuer PLC** | | | | |
| 1,457 % fällig am 21.01.2070 | | 300 | 301 | 0,07 |
| **Thrones PLC** | | | | |
| 1,656 % fällig am 15.11.2049 | | 42 | 42 | 0,01 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 1.450 | 1.455 | 0,34 |
| | | | 9.014 | 2,12 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **United Kingdom Gilt** | | | | |
| 2,000 % fällig am 07.09.2025 (f) | | 16.500 | 17.853 | 4,20 |
| 2,750 % fällig am 07.09.2024 (f) | | 5.000 | 5.539 | 1,30 |
| 3,250 % fällig am 22.01.2044 (f) | | 7.800 | 10.653 | 2,50 |
| 3,500 % fällig am 22.01.2045 (f) | | 28.200 | 40.320 | 9,48 |
| 4,000 % fällig am 22.01.2060 (f) | | 5.900 | 10.651 | 2,50 |
| 4,250 % fällig am 07.12.2046 (f) | | 6.300 | 10.232 | 2,40 |
| | | | 95.248 | 22,38 |
| Summe Großbritannien | | | 299.307 | 70,33 |
| **USA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | |
| 4,763 % fällig am 25.07.2036 | $ | 4 | 3 | 0,00 |
| **JPMorgan Mortgage Acquisition Trust** | | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2036 | | 192 | 150 | 0,04 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | |
| 1,339 % fällig am 15.03.2038 | £ | 2.716 | 2.616 | 0,61 |
| | | | 2.769 | 0,65 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | $ | 200 | 158 | 0,04 |
| **American Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.08.2026 | | 200 | 158 | 0,04 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 1,950 % fällig am 22.05.2026 | € | 300 | 287 | 0,07 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 13.09.2029 | £ | 3.290 | 3.802 | 0,89 |
| 4,563 % fällig am 15.06.2048 | $ | 200 | 171 | 0,04 |
| **Anheuser-Busch Cos. LLC** | | | | |
| 4,900 % fällig am 01.02.2046 | | 700 | 613 | 0,14 |
| **Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.01.2042 | | 1.400 | 1.226 | 0,29 |
| **Apple, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 31.07.2042 | £ | 1.000 | 1.256 | 0,30 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.06.2043 | | 2.900 | 3.233 | 0,76 |
| 4,375 % fällig am 14.09.2029 | | 700 | 806 | 0,19 |
| 4,500 % fällig am 09.03.2048 | $ | 1.000 | 805 | 0,19 |
| 4,875 % fällig am 01.06.2044 | £ | 3.650 | 4.428 | 1,04 |
| 5,200 % fällig am 18.11.2033 | | 1.050 | 1.311 | 0,31 |
| **Berkshire Hathaway Finance Corp.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 19.06.2059 | | 1.400 | 1.486 | 0,35 |
| **Bristol-Myers Squibb Co.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.06.2039 | $ | 100 | 85 | 0,02 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.07.2049 (a) | | 4.100 | 3.302 | 0,78 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 3,878 % fällig am 24.01.2039 | | 1.800 | 1.471 | 0,35 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 09.03.2023 | | 800 | 650 | 0,15 |
| 4,100 % fällig am 25.03.2025 | | 500 | 415 | 0,10 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des UK Long Term Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Digital Euro Finco LLC** | | | |
| 2,500 % fällig am 16.01.2026 | € 100 | £ 98 | 0,02 |
| **Digital Stout Holding LLC** | | | |
| 3,750 % fällig am 17.10.2030 | £ 950 | 1.018 | 0,24 |
| 4,250 % fällig am 17.01.2025 | 100 | 110 | 0,03 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | |
| 4,800 % fällig am 01.02.2049 | $ 200 | 175 | 0,04 |
| **Equinix, Inc.** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.03.2024 | € 1.000 | 938 | 0,22 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** | | | |
| 3,360 % fällig am 21.05.2031 | £ 1.800 | 1.910 | 0,45 |
| **Fiserv, Inc.** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.07.2031 (a) | 1.600 | 1.626 | 0,38 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 4,535 % fällig am 06.03.2025 | 1.100 | 1.155 | 0,27 |
| **General Electric Co.** | | | |
| 5,250 % fällig am 07.12.2028 | 600 | 703 | 0,17 |
| 5,375 % fällig am 18.12.2040 | 1.200 | 1.461 | 0,34 |
| **GlaxoSmithKline Capital, Inc.** | | | |
| 4,200 % fällig am 18.03.2043 | $ 1.700 | 1.500 | 0,35 |
| 6,375 % fällig am 15.05.2038 | 900 | 994 | 0,23 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 3,125 % fällig am 25.07.2029 | £ 2.800 | 2.963 | 0,70 |
| 7,250 % fällig am 10.04.2028 | 1.200 | 1.659 | 0,39 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.02.2027 | $ 1.500 | 1.259 | 0,30 |
| **Home Depot, Inc.** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.09.2056 | 100 | 78 | 0,02 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | |
| 5,050 % fällig am 15.02.2046 | 100 | 86 | 0,02 |
| 5,300 % fällig am 01.12.2034 | 200 | 178 | 0,04 |
| **Merck & Co., Inc.** | | | |
| 3,700 % fällig am 10.02.2045 | 300 | 250 | 0,06 |
| **Microsoft Corp.** | | | |
| 4,000 % fällig am 12.02.2055 | $ 800 | £ 708 | 0,17 |
| 4,250 % fällig am 06.02.2047 | 1.000 | 927 | 0,22 |
| **MidAmerican Energy Co.** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.07.2049 | 100 | 90 | 0,02 |
| **Pfizer, Inc.** | | | |
| 2,735 % fällig am 15.06.2043 | £ 800 | 856 | 0,20 |
| **Prologis LP** | | | |
| 2,250 % fällig am 30.06.2029 | 1.700 | 1.721 | 0,40 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | $ 300 | 245 | 0,06 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.09.2042 | 600 | 441 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 15.07.2042 | £ 1.486 | 1.706 | 0,40 |
| 5,750 % fällig am 02.06.2031 | 780 | 947 | 0,22 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 2,500 % fällig am 08.04.2031 | 1.500 | 1.536 | 0,36 |
| 3,375 % fällig am 27.10.2036 | 600 | 661 | 0,16 |
| 4,400 % fällig am 01.11.2034 | $ 2.600 | 2.268 | 0,53 |
| **Walmart, Inc.** | | | |
| 5,625 % fällig am 27.03.2034 | £ 2.000 | 2.950 | 0,69 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | |
| 2,500 % fällig am 02.05.2029 | 1.000 | 1.029 | 0,24 |
| 3,500 % fällig am 12.09.2029 | 700 | 784 | 0,18 |
| 4,625 % fällig am 02.11.2035 | 2.179 | 2.833 | 0,67 |
| 4,875 % fällig am 29.11.2035 | 450 | 570 | 0,13 |
| **Welltower, Inc.** | | | |
| 4,800 % fällig am 20.11.2028 | 1.700 | 2.013 | 0,47 |
| | | 66.109 | 15,54 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,904 % fällig am 25.04.2035 | $ 303 | 230 | 0,06 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,898 % fällig am 25.09.2035 | $ 3 | £ 3 | 0,00 |
| **HomeBanc Mortgage Trust** | | | |
| 3,074 % fällig am 25.07.2035 | 2.557 | 1.963 | 0,46 |
| **Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,834 % fällig am 15.12.2030 | 11 | 8 | 0,00 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 4,042 % fällig am 20.07.2037 ^ | 18 | 13 | 0,00 |
| | | 2.217 | 0,52 |
| Summe USA | | 71.095 | 16,71 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (g)** | | | |
| | | 498 | 0,12 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 498 | 0,12 |
| **AKTIEN** | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)** | 52.891 | 416 | 0,10 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **£ 527.221** | **123,89** |

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

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

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 12 | £ (24) | (0,01) |
| Kaufoptionen mit Ausübungskurs von 170,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 23 | (37) | (0,01) |
| Euro-Bobl September Futures | Long | 09/2019 | 18 | 14 | 0,01 |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 161 | 358 | 0,09 |
| Euro-OAT France Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 184 | (553) | (0,13) |
| Euro-Schatz September Futures | Long | 09/2019 | 50 | 7 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 168,000 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 12 | 8 | 0,00 |
| Verkaufsoptionen mit Ausübungskurs von 168,500 EUR auf Euro-Bund 10-Year Bond August 2019 Futures[1] | Short | 07/2019 | 23 | 14 | 0,00 |
| United Kingdom Long Gilt September Futures | Long | 09/2019 | 288 | 339 | 0,08 |
| | | | | £ 126 | 0,03 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **£ 126** | **0,03** |

[1] Future-Style-Option.

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 1.500 | £ 45 | 0,01 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 700 | 17 | 0,00 |
| Lincoln National Corp. | 1,000 | 20.12.2021 | 1.400 | 19 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2024 | € 4.600 | 37 | 0,01 |
| Shell International Finance BV | 1,000 | 20.12.2026 | 600 | 35 | 0,01 |
| Shell International Finance BV | 1,000 | 20.06.2027 | 500 | 23 | 0,01 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2023 | 600 | 8 | 0,00 |
| | | | | £ 184 | 0,04 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.IG-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 8.200 | £ 49 | 0,01 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 40.500 | 111 | 0,03 |
| iTraxx Europe Main 31 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | € 33.800 | 164 | 0,04 |
| | | | | £ 324 | 0,08 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,250 % | 21.06.2022 | $ 23.600 | £ (391) | (0,09) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,750 | 21.06.2047 | 1.300 | (105) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,000 | 16.12.2020 | 4.700 | (18) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 15.06.2046 | 5.900 | (117) | (0,03) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 600 | (49) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2024 | 3.300 | (94) | (0,02) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2048 | 1.200 | (151) | (0,04) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.06.2049 | 700 | (62) | (0,02) |
| Erhalt[3] | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 18.12.2049 | 2.500 | 10 | 0,00 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.09.2021 | € 4.800 | (25) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,000 | 18.12.2024 | 4.600 | (17) | 0,00 |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,250 | 18.09.2024 | 4.400 | (79) | (0,02) |
| Erhalt[3] | 6-Month EUR-EURIBOR | 1,000 | 18.12.2049 | 700 | (3) | 0,00 |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 0,750 | 18.12.2021 | £ 6.000 | (4) | 0,00 |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.09.2021 | 9.800 | (60) | (0,01) |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,000 | 18.12.2024 | 11.400 | (10) | 0,00 |
| Erhalt[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.09.2024 | 35.900 | (668) | (0,17) |
| Zahlung[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,250 | 18.12.2049 | 10.900 | (100) | (0,02) |
| Zahlung[3] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 2.600 | (7) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 21.03.2068 | 2.500 | (233) | (0,05) |
| | | | | | £ (2.183) | (0,51) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **£ (1.675)** | **(0,39)** |

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

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

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

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

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

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Call - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Kauf | 0,500 % | 18.09.2019 | 32.200 | £ (21) | £ (31) | (0,01) |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,800 | 18.09.2019 | 32.200 | (17) | (15) | (0,01) |
| BRC | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 20.200 | (31) | (5) | 0,00 |
| CKL | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 18.09.2019 | 13.000 | (19) | (4) | 0,00 |
| GST | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.500 | (2) | 0 | 0,00 |
| JPM | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 1.000 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | £ (91) | £ (55) | (0,02) |

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschlussprämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GST | Rio Tinto Finance USA Ltd. | 1,000 % | 20.12.2021 | $ 2.700 | £ (24) | £ 65 | £ 41 | 0,01 |
| JPM | Heathrow Funding Ltd. | 1,000 | 20.06.2024 | € 6.400 | 10 | 35 | 45 | 0,01 |
| | | | | | £ (14) | £ 100 | £ 86 | 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.

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 08/2019 | £ 392 | € 438 | £ 1 | £ 0 | £ 1 | 0,00 |
| BPS | 08/2019 | € 754 | £ 670 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ 1.700 | $ 2.163 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 987 | £ 783 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| CBK | 08/2019 | £ 817 | $ 1.040 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ 1.003 | £ 788 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| HUS | 08/2019 | € 232 | 204 | 0 | (3) | (3) | 0,00 |
| JPM | 08/2019 | $ 53.135 | 40.613 | 0 | (1.050) | (1.050) | (0,25) |
| RYL | 08/2019 | € 405 | 361 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 08/2019 | £ 440 | $ 562 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 08/2019 | € 20.135 | £ 17.433 | 0 | (610) | (610) | (0,14) |
| SSB | 08/2019 | 589 | 519 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | | | | £ 12 | £ (1.683) | £ (1.671) | (0,39) |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **£ (1.640)** | **(0,39)** |
| **Summe Anlagen** | **£ 524.032** | **123,14** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **£ (98.461)** | **(23,14)** |
| **Nettovermögen** | **£ 425.571** | **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) Unbegrenzte Laufzeit; das gegebenenfalls angegebene Datum stellt den nächsten vertraglichen Kündigungstermin dar.**

**(d) Mit dem Fonds verbunden.**

**(e) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von GBP 110.327 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von GBP 3.147 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von GBP 7.168 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 1.600 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(g) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 634 | U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2021 | £ (509) | £ 498 | £ 498 | 0,12 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **£ (509)** | **£ 498** | **£ 498** | **0,12** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 12.978 | £ 514.243 | £ 0 | £ 527.221 |
| Finanzderivate[3] | 126 | (3.315) | 0 | (3.189) |
| **Summen** | **£ 13.104** | **£ 510.928** | **£ 0** | **£ 524.032** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | £ 1.624 | £ 452.099 | £ 0 | £ 453.723 |
| Finanzderivate[3] | 90 | (786) | 0 | (696) |
| **Summen** | **£ 1.714** | **£ 451.313** | **£ 0** | **£ 453.027** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| IND | 0,950 % | 17.04.2019 | 08.08.2019 | £ (2.572) | £ (2.577) | (0,61) |
| SCX | 0,890 | 10.04.2019 | 08.08.2019 | (90.703) | (90.887) | (21,36) |
| | 0,920 | 22.05.2019 | 18.07.2019 | (15.030) | (15.045) | (3,53) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **£ (108.509)** | **(25,50)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | £ 1 | £ 0 | £ 1 |
| BPS | (46) | 0 | (46) |
| BRC | (5) | 0 | (5) |
| CKL | (4) | 0 | (4) |
| GST | 41 | 0 | 41 |
| HUS | (3) | 0 | (3) |
| JPM | (1.005) | 1.080 | 75 |
| RYL | (1) | 0 | (1) |
| SCX | (610) | 520 | (90) |
| SSB | (8) | 0 | (8) |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 121,21 | 117,27 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 2,56 | 4,40 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,12 | 0,09 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,03 | 0,03 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,39) | 0,06 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | (0,39) | (0,27) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (25,50) | (24,30) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 1,29 | 1,35 |
| Österreich | 0,31 | 0,00 |
| Belgien | 0,04 | 0,00 |
| Bermuda | 0,34 | 0,36 |
| Brasilien | 0,07 | 0,00 |
| Cayman-Inseln | 1,23 | 2,17 |
| Dänemark | 1,00 | 0,71 |
| Finnland | 0,02 | 0,02 |
| Frankreich | 6,22 | 4,35 |
| Deutschland | 0,93 | 0,96 |
| Guernsey, Kanalinseln | 0,50 | 0,53 |
| Hongkong | 0,04 | 0,04 |
| Irland | 4,98 | 1,91 |
| Italien | 0,64 | 0,69 |
| Japan | 0,09 | 0,10 |
| Jersey, Kanalinseln | 3,22 | 3,61 |
| Luxemburg | 1,51 | 1,41 |
| Niederlande | 7,03 | 6,63 |
| Norwegen | 0,04 | 0,04 |
| Singapur | 0,70 | 0,75 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Spanien | 0,46 | 0,31 |
| Supranational | 4,77 | 5,27 |
| Schweden | 0,14 | 0,15 |
| Schweiz | 1,06 | 0,93 |
| Großbritannien | 70,33 | 71,38 |
| Vereinigte Staaten | 16,71 | 15,33 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,12 | 2,65 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,10 | 0,11 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,03 | 0,03 |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,04 | 0,01 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,08 | (0,13) |
| Zinsswaps | (0,51) | 0,18 |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | (0,02) | 0,00 |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,02 | 0,01 |
| Devisenterminkontrakte | (0,39) | (0,28) |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (23,14) | (21,58) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | | |
| 6,579 % fällig am 01.05.2026 | $ | 1.697 | $ 1.701 | 0,06 |
| **Neiman Marcus Group Ltd. LLC** | | | | |
| 7,972 % fällig am 25.10.2023 | | 1.991 | 1.747 | 0,06 |
| **Petco Animal Supplies, Inc.** | | | | |
| 5,833 % fällig am 26.01.2023 | | 2.729 | 2.128 | 0,07 |
| **Serta Simmons Bedding LLC** | | | | |
| 5,894 % - 5,912 % fällig am 08.11.2023 | | 2.729 | 1.764 | 0,06 |
| | | | 7.340 | 0,25 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **Alliant Holdings Intermediate LLC** | | | | |
| 8,250 % fällig am 01.08.2023 | | 5.000 | 5.149 | 0,18 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 21.05.2024 | | 4.000 | 4.105 | 0,14 |
| 5,125 % fällig am 30.09.2024 | | 3.750 | 4.059 | 0,14 |
| 7,500 % fällig am 15.09.2020 | | 2.736 | 2.886 | 0,10 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2020 | | 4.016 | 4.170 | 0,14 |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 3.684 | 4.876 | 0,17 |
| **ASP AMC Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.05.2025 | | 5.000 | 3.013 | 0,10 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 7,375 % fällig am 19.08.2025 (e)(g) | | 5.000 | 5.560 | 0,19 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 4.500 | 4.786 | 0,17 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2023 | | 3.000 | 3.214 | 0,11 |
| 6,125 % fällig am 09.03.2028 | | 1.000 | 1.140 | 0,04 |
| **Credit Agricole S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 23.01.2024 (e)(g) | | 5.000 | 5.518 | 0,19 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 6,250 % fällig am 18.12.2024 (e)(g) | | 5.000 | 5.222 | 0,18 |
| **ESH Hospitality, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.05.2025 | | 3.750 | 3.848 | 0,13 |
| **Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 5.000 | 5.162 | 0,18 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.11.2024 | | 2.750 | 2.351 | 0,08 |
| **Getty Images, Inc.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 01.03.2027 | | 5.000 | 5.163 | 0,18 |
| **Greystar Real Estate Partners LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.12.2025 | | 2.750 | 2.812 | 0,10 |
| **Howard Hughes Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.03.2025 | | 4.750 | 4.931 | 0,17 |
| **HUB International Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 01.05.2026 | | 6.000 | 6.097 | 0,21 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | | |
| 5,017 % fällig am 26.06.2024 | | 1.000 | 1.003 | 0,03 |
| 5,710 % fällig am 15.01.2026 | | 3.000 | 3.039 | 0,11 |
| 7,700 % fällig am 17.09.2025 (e)(g) | | 4.750 | 4.671 | 0,16 |
| **Lehman Brothers Holdings, Inc.** | | | | |
| 8,160 % fällig am 30.05.2009 ^ | | 20 | 12 | 0,00 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 27.06.2024 (e)(g) | | 5.000 | 5.269 | 0,18 |
| 7,625 % fällig am 27.06.2023 (e)(g) | £ | 3.000 | 4.166 | 0,14 |
| **MGM Growth Properties Operating Partnership LP** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.09.2026 | $ | 2.000 | 2.063 | 0,07 |
| 5,625 % fällig am 01.05.2024 | | 2.000 | 2.163 | 0,08 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2027 | | 1.000 | 1.079 | 0,04 |
| **Navient Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 26.10.2020 | | 1.500 | 1.534 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 25.10.2024 | | 5.000 | 5.081 | 0,18 |
| 6,125 % fällig am 25.03.2024 | | 2.000 | 2.060 | 0,07 |
| 6,500 % fällig am 15.06.2022 | | 1.000 | 1.065 | 0,04 |
| 6,625 % fällig am 26.07.2021 | | 1.000 | 1.061 | 0,04 |
| 6,750 % fällig am 25.06.2025 | | 2.000 | 2.075 | 0,07 |
| 7,250 % fällig am 25.01.2022 | | 2.000 | 2.165 | 0,08 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | | 2.000 | 2.075 | 0,07 |
| **Quicken Loans, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | | 2.500 | 2.497 | 0,09 |
| 5,750 % fällig am 01.05.2025 | | 3.500 | 3.627 | 0,13 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | |
| 7,500 % fällig am 10.08.2020 (e)(g) | $ | 4.000 | $ 4.110 | 0,14 |
| 7,648 % fällig am 30.09.2031 (e) | | 2.750 | 3.596 | 0,12 |
| **SLM Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 05.04.2022 | | 2.000 | 1.990 | 0,07 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.05.2022 | | 1.000 | 1.078 | 0,04 |
| 6,125 % fällig am 15.03.2024 | | 3.000 | 3.233 | 0,11 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 | | 2.250 | 2.368 | 0,08 |
| 6,875 % fällig am 15.03.2025 | | 3.500 | 3.841 | 0,13 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2026 | | 3.500 | 3.841 | 0,13 |
| **USI, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.05.2025 | | 14.000 | 13.895 | 0,48 |
| **Voyager Aviation Holdings LLC** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.08.2021 | | 5.000 | 5.088 | 0,18 |
| | | | 173.807 | 6,01 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | | |
| **24 Hour Fitness Worldwide, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.06.2022 (i) | | 9.750 | 9.652 | 0,33 |
| **Adient Global Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.08.2026 | | 6.000 | 4.800 | 0,17 |
| **ADT Security Corp.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 5.000 | 5.006 | 0,17 |
| 4,125 % fällig am 15.06.2023 | | 4.250 | 4.258 | 0,15 |
| 4,875 % fällig am 15.07.2032 | | 2.750 | 2.386 | 0,08 |
| **Advanced Disposal Services, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.11.2024 | | 3.500 | 3.679 | 0,13 |
| **Air Medical Group Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2023 | | 12.875 | 11.587 | 0,40 |
| **Alcoa Nederland Holding BV** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.05.2028 | | 750 | 786 | 0,03 |
| 6,750 % fällig am 30.09.2024 | | 1.000 | 1.061 | 0,04 |
| 7,000 % fällig am 30.09.2026 | | 1.000 | 1.075 | 0,04 |
| **Aleris International, Inc.** | | | | |
| 10,750 % fällig am 15.07.2023 | | 5.000 | 5.231 | 0,18 |
| **Alpha BV** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.02.2025 | | 8.000 | 7.920 | 0,27 |
| **Alpha BV (8,750 % bar oder 9,500 % PIK)** | | | | |
| 8,750 % fällig am 01.06.2023 (b) | | 4.750 | 4.691 | 0,16 |
| **Altice Financing S.A.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 15.02.2023 | | 4.000 | 4.110 | 0,14 |
| 7,500 % fällig am 15.05.2026 | | 5.000 | 5.038 | 0,17 |
| **Altice Finco S.A.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | | 3.000 | 2.891 | 0,10 |
| **Altice France S.A.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.05.2024 | | 3.795 | 3.923 | 0,14 |
| 7,375 % fällig am 01.05.2026 | | 10.000 | 10.275 | 0,35 |
| 8,125 % fällig am 01.02.2027 | | 2.000 | 2.105 | 0,07 |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | | 5.000 | 4.722 | 0,16 |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 | | 1.537 | 1.566 | 0,05 |
| 10,500 % fällig am 15.05.2027 | | 2.750 | 2.832 | 0,10 |
| **AMC Networks, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.08.2025 | | 2.000 | 2.028 | 0,07 |
| 5,000 % fällig am 01.04.2024 | | 4.500 | 4.641 | 0,16 |
| **American Builders & Contractors Supply Co., Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.12.2023 | | 2.000 | 2.078 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 3.500 | 3.662 | 0,13 |
| **Amsted Industries, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.07.2027 | | 2.000 | 2.090 | 0,07 |
| **Antero Resources Corp.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.12.2022 | | 3.000 | 2.891 | 0,10 |
| **Aramark Services, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.06.2026 | | 3.000 | 3.060 | 0,11 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2028 | | 2.250 | 2.320 | 0,08 |
| **Arconic, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2024 | | 3.750 | 3.963 | 0,14 |
| 5,900 % fällig am 01.02.2027 | | 750 | 817 | 0,03 |
| 5,950 % fällig am 01.02.2037 | | 3.000 | 3.123 | 0,11 |
| **Ardagh Packaging Finance PLC** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.02.2025 | | 3.750 | 3.895 | 0,13 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2024 | | 4.000 | 4.230 | 0,15 |
| **Ascend Learning LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.08.2025 | | 17.500 | 17.882 | 0,62 |
| **Ashland LLC** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.08.2022 | $ | 2.000 | $ 2.098 | 0,07 |
| 6,875 % fällig am 15.05.2043 | | 2.750 | 2.977 | 0,10 |
| **Associated Materials LLC** | | | | |
| 9,000 % fällig am 01.01.2024 | | 14.000 | 13.335 | 0,46 |
| **Avantor, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 01.10.2024 | | 4.000 | 4.266 | 0,15 |
| 9,000 % fällig am 01.10.2025 | | 10.000 | 11.175 | 0,39 |
| **Avon International Operations, Inc.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.08.2022 | | 4.750 | 4.952 | 0,17 |
| **B.C. Unlimited Liability Co.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2024 | | 1.500 | 1.521 | 0,05 |
| 5,000 % fällig am 15.10.2025 | | 8.500 | 8.588 | 0,30 |
| **Bausch Health Americas, Inc.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 31.01.2027 | | 2.000 | 2.204 | 0,08 |
| **Bausch Health Cos., Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2023 | | 795 | 804 | 0,03 |
| 5,500 % fällig am 01.11.2025 | | 9.500 | 9.939 | 0,34 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2027 | | 1.000 | 1.053 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 15.05.2023 | | 1.963 | 1.993 | 0,07 |
| 6,125 % fällig am 15.04.2025 | | 6.000 | 6.142 | 0,21 |
| 7,000 % fällig am 15.03.2024 | | 3.500 | 3.728 | 0,13 |
| 7,000 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | 5.194 | 0,18 |
| 7,250 % fällig am 30.05.2029 | | 3.000 | 3.127 | 0,11 |
| 9,000 % fällig am 15.12.2025 | | 7.000 | 7.847 | 0,27 |
| **BCD Acquisition, Inc.** | | | | |
| 9,625 % fällig am 15.09.2023 | | 5.750 | 6.059 | 0,21 |
| **BCPE Cycle Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 10,625 % fällig am 15.07.2027 | | 5.750 | 5.836 | 0,20 |
| **Beacon Roofing Supply, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.11.2025 | | 13.750 | 13.664 | 0,47 |
| 6,375 % fällig am 01.10.2023 | | 2.000 | 2.088 | 0,07 |
| **Berry Global Escrow Corp.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.07.2027 | | 3.250 | 3.388 | 0,12 |
| **Berry Global, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.02.2026 | | 1.000 | 988 | 0,03 |
| 5,125 % fällig am 15.07.2023 | | 2.000 | 2.052 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 15.10.2022 | | 2.500 | 2.556 | 0,09 |
| **Bombardier, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.03.2022 | | 3.250 | 3.311 | 0,11 |
| 7,500 % fällig am 01.12.2024 | | 3.000 | 3.067 | 0,11 |
| 7,500 % fällig am 15.03.2025 | | 5.000 | 5.033 | 0,17 |
| 7,875 % fällig am 15.04.2027 | | 2.000 | 2.008 | 0,07 |
| 8,750 % fällig am 01.12.2021 | | 5.000 | 5.469 | 0,19 |
| **Boyd Gaming Corp.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.08.2026 | | 1.750 | 1.846 | 0,06 |
| 6,875 % fällig am 15.05.2023 | | 3.000 | 3.109 | 0,11 |
| **Brand Industrial Services, Inc.** | | | | |
| 8,500 % fällig am 15.07.2025 | | 15.000 | 13.669 | 0,47 |
| **Brazos Valley Longhorn LLC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 01.02.2025 | | 5.750 | 5.434 | 0,19 |
| **Builders FirstSource, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.09.2024 | | 2.750 | 2.845 | 0,10 |
| 6,750 % fällig am 01.06.2027 | | 1.450 | 1.537 | 0,05 |
| **BWAY Holding Co.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2024 | | 4.750 | 4.770 | 0,16 |
| 7,250 % fällig am 15.04.2025 | | 6.000 | 5.812 | 0,20 |
| **Cablevision Systems Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2022 | | 4.500 | 4.736 | 0,16 |
| **Caesars Resort Collection LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.10.2025 | | 12.000 | 12.067 | 0,42 |
| **California Resources Corp.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 15.12.2022 | | 4.500 | 3.414 | 0,12 |
| **Camelot Finance S.A.** | | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2024 | | 12.250 | 12.908 | 0,45 |
| **Carlson Travel, Inc.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 15.12.2024 | | 4.000 | 4.010 | 0,14 |
| **Catalent Pharma Solutions, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2026 | | 5.000 | 5.094 | 0,18 |
| **CCO Holdings LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2028 | | 5.000 | 5.118 | 0,18 |
| 5,125 % fällig am 01.05.2023 | | 3.500 | 3.582 | 0,12 |
| 5,125 % fällig am 01.05.2027 | | 7.500 | 7.784 | 0,27 |
| 5,375 % fällig am 01.05.2025 | | 3.500 | 3.627 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 01.06.2029 | | 4.000 | 4.140 | 0,14 |
| 5,750 % fällig am 01.09.2023 | | 2.000 | 2.049 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 15.02.2026 | | 12.250 | 12.878 | 0,44 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| 5,875 % fällig am 01.04.2024 | $ 4.000 | $ 4.190 | 0,14 |
| 5,875 % fällig am 01.05.2027 | 3.000 | 3.172 | 0,11 |
| **Centene Corp.** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2025 | 2.000 | 2.069 | 0,07 |
| 5,375 % fällig am 01.06.2026 | 1.750 | 1.844 | 0,06 |
| 6,125 % fällig am 15.02.2024 | 1.500 | 1.573 | 0,05 |
| **Centennial Resource Production LLC** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2026 | 6.750 | 6.446 | 0,22 |
| **CF Industries, Inc.** | | | |
| 5,150 % fällig am 15.03.2034 | 4.750 | 4.667 | 0,16 |
| **Change Healthcare Holdings LLC** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.03.2025 | 7.500 | 7.641 | 0,26 |
| **Chemours Co.** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2023 | 2.750 | 2.855 | 0,10 |
| 7,000 % fällig am 15.05.2025 | 3.750 | 3.928 | 0,14 |
| **Cheniere Corpus Christi Holdings LLC** | | | |
| 5,125 % fällig am 30.06.2027 | 4.500 | 4.899 | 0,17 |
| 5,875 % fällig am 31.03.2025 | 2.000 | 2.233 | 0,08 |
| 7,000 % fällig am 30.06.2024 | 4.000 | 4.610 | 0,16 |
| **Cheniere Energy Partners LP** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.10.2025 | 4.000 | 4.150 | 0,14 |
| 5,625 % fällig am 01.10.2026 | 1.000 | 1.058 | 0,04 |
| **Chesapeake Energy Corp.** | | | |
| 8,000 % fällig am 15.01.2025 | 9.500 | 8.859 | 0,31 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2026 | 3.071 | 2.802 | 0,10 |
| **Chobani LLC** | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2025 | 7.000 | 6.580 | 0,23 |
| **Cirsa Finance International SARL** | | | |
| 7,875 % fällig am 20.12.2023 | 2.500 | 2.656 | 0,09 |
| **Clear Channel Communication, Inc.** | | | |
| 9,000 % fällig am 01.03.2021 | 6.500 | 0 | 0,00 |
| **Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.11.2022 | 4.750 | 4.881 | 0,17 |
| 9,250 % fällig am 15.02.2024 | 10.000 | 10.875 | 0,38 |
| **Clearwater Paper Corp.** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2023 | 1.000 | 955 | 0,03 |
| 5,375 % fällig am 01.02.2025 | 2.250 | 2.053 | 0,07 |
| **Cleveland-Cliffs, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2027 | 2.500 | 2.438 | 0,08 |
| **Colfax Corp.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.02.2024 | 2.000 | 2.123 | 0,07 |
| 6,375 % fällig am 15.02.2026 | 1.000 | 1.074 | 0,04 |
| **CommScope Technologies LLC** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2027 | 3.000 | 2.625 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 15.06.2025 | 3.000 | 2.827 | 0,10 |
| **CommScope, Inc.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.06.2021 | 2.000 | 2.003 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2024 | 1.250 | 1.289 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 15.06.2024 | 1.750 | 1.678 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 01.03.2026 | 2.000 | 2.060 | 0,07 |
| 8,250 % fällig am 01.03.2027 | 1.850 | 1.894 | 0,07 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2021 | 5.500 | 5.397 | 0,19 |
| 6,250 % fällig am 31.03.2023 | 7.000 | 6.764 | 0,23 |
| 6,875 % fällig am 01.02.2022 | 3.000 | 2.040 | 0,07 |
| 8,000 % fällig am 15.03.2026 | 2.000 | 1.929 | 0,07 |
| 8,125 % fällig am 30.06.2024 | 5.000 | 3.762 | 0,13 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2024 | 3.000 | 3.007 | 0,10 |
| 9,875 % fällig am 30.06.2023 | 3.250 | 2.660 | 0,09 |
| **Constellium NV** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | 3.000 | 3.090 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 15.02.2026 | 3.000 | 3.090 | 0,11 |
| 6,625 % fällig am 01.03.2025 | 2.000 | 2.085 | 0,07 |
| **Core & Main LP** | | | |
| 6,125 % fällig am 15.08.2025 | 20.000 | 20.300 | 0,70 |
| **Cornerstone Building Brands, Inc.** | | | |
| 8,000 % fällig am 15.04.2026 | 15.000 | 14.662 | 0,51 |
| **Coty, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.04.2026 | 5.000 | 4.881 | 0,17 |
| **Covey Park Energy LLC** | | | |
| 7,500 % fällig am 15.05.2025 | 4.750 | 3.444 | 0,12 |
| **CPG Merger Sub LLC** | | | |
| 8,000 % fällig am 01.10.2021 | 10.000 | 10.187 | 0,35 |
| **Crown Americas LLC** | | | |
| 4,250 % fällig am 30.09.2026 | 4.500 | 4.607 | 0,16 |
| **CSC Holdings LLC** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.12.2021 | 3.000 | 3.007 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 01.06.2024 | $ 7.000 | $ 7.289 | 0,25 |
| 5,500 % fällig am 15.05.2026 | 3.000 | 3.154 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2027 | 2.500 | 2.631 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 01.02.2029 | 2.500 | 2.733 | 0,09 |
| 6,625 % fällig am 15.10.2025 | 1.000 | 1.073 | 0,04 |
| **DAE Funding LLC** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.08.2022 | 1.000 | 1.018 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | 4.000 | 4.175 | 0,14 |
| 5,750 % fällig am 15.11.2023 | 1.500 | 1.579 | 0,05 |
| **DaVita, Inc.** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.05.2025 | 3.750 | 3.716 | 0,13 |
| 5,125 % fällig am 15.07.2024 | 3.500 | 3.510 | 0,12 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2022 | 2.000 | 2.025 | 0,07 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.06.2021 | 750 | 763 | 0,03 |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | 1.750 | 1.848 | 0,06 |
| **Dell, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.04.2038 | 500 | 527 | 0,02 |
| 7,100 % fällig am 15.04.2028 | 1.000 | 1.120 | 0,04 |
| **Denbury Resources, Inc.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.07.2023 | 2.500 | 1.281 | 0,04 |
| 5,500 % fällig am 01.05.2022 | 536 | 314 | 0,01 |
| 7,750 % fällig am 15.02.2024 | 4.329 | 3.615 | 0,12 |
| 9,000 % fällig am 15.05.2021 | 1.750 | 1.733 | 0,06 |
| **Diamond BC BV** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.08.2025 | € 7.000 | 6.706 | 0,23 |
| **Diamond Offshore Drilling, Inc.** | | | |
| 4,875 % fällig am 01.11.2043 | $ 1.500 | 938 | 0,03 |
| 5,700 % fällig am 15.10.2039 | 2.482 | 1.675 | 0,06 |
| 7,875 % fällig am 15.08.2025 | 3.750 | 3.581 | 0,12 |
| **Diamond Resorts International, Inc.** | | | |
| 7,750 % fällig am 01.09.2023 | 3.500 | 3.618 | 0,12 |
| 10,750 % fällig am 01.09.2024 | 3.000 | 2.970 | 0,10 |
| **Diamondback Energy, Inc.** | | | |
| 4,750 % fällig am 01.11.2024 | 2.000 | 2.065 | 0,07 |
| 5,375 % fällig am 31.05.2025 | 3.000 | 3.161 | 0,11 |
| **Digicel Group Two Ltd. (7,125 % bar und 2,000 % PIK)** | | | |
| 9,125 % fällig am 01.04.2024 (b) | 5.021 | 1.105 | 0,04 |
| **Digicel Ltd.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.04.2021 | 1.000 | 763 | 0,03 |
| **DISH DBS Corp.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.03.2023 | 5.000 | 4.850 | 0,17 |
| 5,875 % fällig am 15.07.2022 | 6.750 | 6.877 | 0,24 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2024 | 6.000 | 5.700 | 0,20 |
| 6,750 % fällig am 01.06.2021 | 3.750 | 3.942 | 0,14 |
| 7,750 % fällig am 01.07.2026 | 3.000 | 2.917 | 0,10 |
| **DKT Finance ApS** | | | |
| 9,375 % fällig am 17.06.2023 | 2.250 | 2.444 | 0,08 |
| **DriveTime Automotive Group, Inc.** | | | |
| 8,000 % fällig am 01.06.2021 | 1.375 | 1.393 | 0,05 |
| **Dun & Bradstreet Corp.** | | | |
| 6,875 % fällig am 15.08.2026 | 4.000 | 4.232 | 0,15 |
| 10,250 % fällig am 15.02.2027 | 7.250 | 7.721 | 0,27 |
| **Eagle Holding Co. LLC** | | | |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 (b) | 6.750 | 6.817 | 0,24 |
| **Eagle Holding Co. LLC (7,625 % bar oder 8,375 % PIK)** | | | |
| 7,625 % fällig am 15.05.2022 (b) | 10.000 | 10.075 | 0,35 |
| **Eldorado Resorts, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 01.04.2025 | 2.500 | 2.641 | 0,09 |
| 6,000 % fällig am 15.09.2026 | 2.000 | 2.195 | 0,08 |
| **Element Solutions, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.12.2025 | 5.000 | 5.231 | 0,18 |
| **EMC Corp.** | | | |
| 3,375 % fällig am 01.06.2023 | 2.000 | 1.991 | 0,07 |
| **Endo Dac** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2023 | 5.727 | 4.152 | 0,14 |
| 6,000 % fällig am 01.02.2025 | 6.000 | 4.050 | 0,14 |
| **Energizer Holdings, Inc.** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.06.2025 | 5.000 | 5.075 | 0,18 |
| 6,375 % fällig am 15.07.2026 | 1.750 | 1.803 | 0,06 |
| **EnLink Midstream Partners LP** | | | |
| 4,150 % fällig am 01.06.2025 | 4.500 | 4.427 | 0,15 |
| **Ensco Rowan PLC** | | | |
| 4,500 % fällig am 01.10.2024 | 2.000 | 1.500 | 0,05 |
| 5,200 % fällig am 15.03.2025 | 5.000 | 3.700 | 0,13 |
| 5,750 % fällig am 01.10.2044 | 5.750 | 3.335 | 0,12 |
| 7,750 % fällig am 01.02.2026 | 2.000 | 1.500 | 0,05 |
| **Entegris, Inc.** | | | |
| 4,625 % fällig am 10.02.2026 | $ 4.000 | $ 4.050 | 0,14 |
| **Envision Healthcare Corp.** | | | |
| 8,750 % fällig am 15.10.2026 | 15.000 | 10.537 | 0,36 |
| **Extraction Oil & Gas, Inc.** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2026 | 3.500 | 2.844 | 0,10 |
| **Fairstone Financial, Inc.** | | | |
| 7,875 % fällig am 15.07.2024 (a) | 4.000 | 4.087 | 0,14 |
| **First Data Corp.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2024 | 2.000 | 2.050 | 0,07 |
| 5,375 % fällig am 15.08.2023 | 2.000 | 2.039 | 0,07 |
| **First Quality Finance Co., Inc.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.05.2021 | 2.000 | 2.003 | 0,07 |
| **First Quantum Minerals Ltd.** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.03.2024 | 1.000 | 939 | 0,03 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2022 | 1.500 | 1.498 | 0,05 |
| 7,250 % fällig am 01.04.2023 | 2.000 | 1.955 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 01.04.2025 | 1.000 | 956 | 0,03 |
| **Flex Acquisition Co., Inc.** | | | |
| 6,875 % fällig am 15.01.2025 | 8.000 | 7.280 | 0,25 |
| 7,875 % fällig am 15.07.2026 | 5.750 | 5.319 | 0,18 |
| **Freeport-McMoRan, Inc.** | | | |
| 3,550 % fällig am 01.03.2022 | 3.000 | 3.019 | 0,10 |
| 3,875 % fällig am 15.03.2023 | 2.500 | 2.506 | 0,09 |
| 4,000 % fällig am 14.11.2021 | 2.000 | 2.045 | 0,07 |
| 5,400 % fällig am 14.11.2034 | 8.000 | 7.700 | 0,27 |
| **Gates Global LLC** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2022 | 5.721 | 5.732 | 0,20 |
| **GCP Applied Technologies, Inc.** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2026 | 4.500 | 4.590 | 0,16 |
| **Golden Entertainment, Inc.** | | | |
| 7,625 % fällig am 15.04.2026 | 4.250 | 4.356 | 0,15 |
| **Golden Nugget, Inc.** | | | |
| 6,750 % fällig am 15.10.2024 | 5.250 | 5.421 | 0,19 |
| **Gray Television, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.07.2026 | 2.000 | 2.080 | 0,07 |
| **Griffon Corp.** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.03.2022 | 4.750 | 4.744 | 0,16 |
| **Grinding Media, Inc.** | | | |
| 7,375 % fällig am 15.12.2023 | 2.000 | 1.925 | 0,07 |
| **Gulfport Energy Corp.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.10.2024 | 1.750 | 1.361 | 0,05 |
| 6,375 % fällig am 15.05.2025 | 2.500 | 1.947 | 0,07 |
| 6,625 % fällig am 01.05.2023 | 5.000 | 4.325 | 0,15 |
| **Hadrian Merger Sub, Inc.** | | | |
| 8,500 % fällig am 01.05.2026 | 6.000 | 5.685 | 0,20 |
| **Hanesbrands, Inc.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.05.2024 | 5.000 | 5.216 | 0,18 |
| 4,875 % fällig am 15.05.2026 | 1.750 | 1.824 | 0,06 |
| **Harsco Corp.** | | | |
| 5,750 % fällig am 31.07.2027 | 2.000 | 2.088 | 0,07 |
| **HCA Healthcare, Inc.** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2021 | 4.000 | 4.200 | 0,15 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 5,375 % fällig am 01.02.2025 | 5.000 | 5.409 | 0,19 |
| 5,875 % fällig am 01.05.2023 | 6.500 | 7.084 | 0,24 |
| 7,500 % fällig am 15.02.2022 | 4.000 | 4.420 | 0,15 |
| **HD Supply, Inc.** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.10.2026 | 6.250 | 6.625 | 0,23 |
| **Hexion, Inc.** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.04.2020 ^ | 2.750 | 2.145 | 0,07 |
| 10,375 % fällig am 01.02.2022 ^ | 1.375 | 1.055 | 0,04 |
| **High Ridge Brands Co.** | | | |
| 8,875 % fällig am 15.03.2025 | 2.500 | 250 | 0,01 |
| **Hilton Domestic Operating Co., Inc.** | | | |
| 4,250 % fällig am 01.09.2024 | 1.000 | 1.018 | 0,04 |
| 4,875 % fällig am 15.01.2030 | 2.000 | 2.065 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 01.05.2026 | 3.000 | 3.139 | 0,11 |
| **iHeartCommunications, Inc.** | | | |
| 6,375 % fällig am 01.05.2026 | 500 | 533 | 0,02 |
| 8,375 % fällig am 01.05.2027 | 1.000 | 1.053 | 0,04 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % bar oder 5,500 % PIK)** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.09.2026 (b) | 4.000 | 3.915 | 0,14 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % bar oder 6,750 % PIK)** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2027 (b) | 2.000 | 2.015 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar oder 7,125 % PIK)** | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2029 (b) | $ 1.750 | $ 1.754 | 0,06 |
| **Immucor, Inc.** | | | |
| 11,125 % fällig am 15.02.2022 | 5.000 | 5.125 | 0,18 |
| **Indigo Natural Resources LLC** | | | |
| 6,875 % fällig am 15.02.2026 | 3.000 | 2.707 | 0,09 |
| **INEOS Group Holdings S.A.** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.08.2024 | 2.000 | 2.050 | 0,07 |
| **Informatica LLC** | | | |
| 7,125 % fällig am 15.07.2023 | 10.000 | 10.202 | 0,35 |
| **Intelsat Connect Finance S.A.** | | | |
| 9,500 % fällig am 15.02.2023 | 5.000 | 4.450 | 0,15 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.08.2023 | 7.625 | 6.996 | 0,24 |
| 8,000 % fällig am 15.02.2024 | 1.750 | 1.829 | 0,06 |
| 8,500 % fällig am 15.10.2024 | 7.250 | 7.214 | 0,25 |
| 9,750 % fällig am 15.07.2025 | 5.000 | 5.125 | 0,18 |
| **International Game Technology PLC** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2022 | 2.000 | 2.123 | 0,07 |
| 6,250 % fällig am 15.01.2027 | 2.500 | 2.744 | 0,09 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2025 | 4.500 | 4.939 | 0,17 |
| **IQVIA, Inc.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.10.2026 | 6.250 | 6.477 | 0,22 |
| **Jagged Peak Energy LLC** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.05.2026 | 2.750 | 2.722 | 0,09 |
| **Jaguar Holding Co.** | | | |
| 6,375 % fällig am 01.08.2023 | 10.500 | 10.894 | 0,38 |
| **Jeld-Wen, Inc.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.12.2025 | 5.000 | 4.919 | 0,17 |
| 4,875 % fällig am 15.12.2027 | 6.000 | 5.820 | 0,20 |
| **KFC Holding Co.** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2026 | 3.000 | 3.154 | 0,11 |
| **Kinetic Concepts Inc.** | | | |
| 12,500 % fällig am 01.11.2021 | 15.000 | 16.556 | 0,57 |
| **Kronos Acquisition Holdings, Inc.** | | | |
| 9,000 % fällig am 15.08.2023 | 10.750 | 9.514 | 0,33 |
| **LABL Escrow Issuer LLC** | | | |
| 6,750 % fällig am 15.07.2026 (a) | 3.000 | 3.034 | 0,10 |
| 10,500 % fällig am 15.07.2027 (a) | 3.000 | 3.004 | 0,10 |
| **Lamb Weston Holdings, Inc.** | | | |
| 4,625 % fällig am 01.11.2024 | 2.000 | 2.083 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 01.11.2026 | 2.000 | 2.090 | 0,07 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2023 | 1.750 | 1.771 | 0,06 |
| 5,250 % fällig am 15.03.2026 | 3.500 | 3.631 | 0,13 |
| 5,375 % fällig am 15.01.2024 | 1.000 | 1.025 | 0,04 |
| 5,375 % fällig am 01.05.2025 | 3.000 | 3.105 | 0,11 |
| **Mallinckrodt International Finance S.A.** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.04.2025 (i) | 2.000 | 1.350 | 0,05 |
| 5,625 % fällig am 15.10.2023 (i) | 1.500 | 1.140 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 01.08.2022 (i) | 2.500 | 2.163 | 0,07 |
| **Marriott Ownership Resorts, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.09.2026 | 1.250 | 1.347 | 0,05 |
| **Masonite International Corp.** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.03.2023 | 3.750 | 3.877 | 0,13 |
| **Matador Resources Co.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2026 | 3.750 | 3.806 | 0,13 |
| **Mattel, Inc.** | | | |
| 6,750 % fällig am 31.12.2025 | 5.500 | 5.672 | 0,20 |
| **Matterhorn Merger Sub LLC** | | | |
| 8,500 % fällig am 01.06.2026 | 15.000 | 13.387 | 0,46 |
| **MDC Holdings, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.01.2043 | 2.750 | 2.585 | 0,09 |
| **MDC Partners, Inc.** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.05.2024 | 2.000 | 1.848 | 0,06 |
| **Men's Wearhouse, Inc.** | | | |
| 7,000 % fällig am 01.07.2022 | 4.045 | 3.914 | 0,14 |
| **MGM China Holdings Ltd.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.05.2026 | 1.375 | 1.415 | 0,05 |
| **MGM Resorts International** | | | |
| 4,625 % fällig am 01.09.2026 | 5.000 | 5.050 | 0,17 |
| 6,000 % fällig am 15.03.2023 | 5.750 | 6.246 | 0,22 |
| 6,625 % fällig am 15.12.2021 | 5.000 | 5.412 | 0,19 |
| 7,750 % fällig am 15.03.2022 | 2.000 | 2.235 | 0,08 |
| **MPH Acquisition Holdings LLC** | | | |
| 7,125 % fällig am 01.06.2024 | 8.000 | 7.542 | 0,26 |
| **MSCI, Inc.** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.11.2024 | $ 1.000 | $ 1.038 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 15.08.2025 | 2.750 | 2.901 | 0,10 |
| **Murphy Oil Corp.** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.08.2025 | 2.000 | 2.083 | 0,07 |
| 6,875 % fällig am 15.08.2024 | 2.000 | 2.110 | 0,07 |
| **Murphy Oil USA, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.08.2023 | 2.000 | 2.063 | 0,07 |
| **Nabors Industries, Inc.** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.02.2025 | 5.750 | 5.125 | 0,18 |
| **NCR Corp.** | | | |
| 4,625 % fällig am 15.02.2021 | 1.250 | 1.256 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 15.07.2022 | 3.000 | 3.040 | 0,10 |
| 6,375 % fällig am 15.12.2023 | 1.000 | 1.034 | 0,04 |
| **Netflix, Inc.** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.11.2026 | 5.000 | 5.126 | 0,18 |
| 4,875 % fällig am 15.04.2028 | 4.000 | 4.135 | 0,14 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2029 | 1.500 | 1.597 | 0,06 |
| 5,875 % fällig am 15.02.2025 | 1.500 | 1.658 | 0,06 |
| **Nexstar Broadcasting, Inc.** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.08.2024 | 3.000 | 3.115 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 15.11.2022 | 1.750 | 1.794 | 0,06 |
| **Nexstar Escrow, Inc.** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.07.2027 (a) | 1.500 | 1.539 | 0,05 |
| **Nexteer Automotive Group Ltd.** | | | |
| 5,875 % fällig am 15.11.2021 | 1.000 | 1.018 | 0,04 |
| **Nidda BondCo GmbH** | | | |
| 5,000 % fällig am 30.09.2025 | € 5.000 | 5.619 | 0,19 |
| **Nielsen Co. Luxembourg SARL** | | | |
| 5,000 % fällig am 01.02.2025 (i) | $ 4.000 | 3.950 | 0,14 |
| **Nielsen Finance LLC** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.04.2022 | 5.000 | 5.012 | 0,17 |
| **Nine Energy Service, Inc.** | | | |
| 8,750 % fällig am 01.11.2023 | 2.000 | 1.960 | 0,07 |
| **Noble Holding International Ltd.** | | | |
| 7,875 % fällig am 01.02.2026 | 6.000 | 5.184 | 0,18 |
| **Norbord, Inc.** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.07.2027 | 3.000 | 3.026 | 0,10 |
| **Novelis Corp.** | | | |
| 5,875 % fällig am 30.09.2026 | 9.000 | 9.135 | 0,32 |
| 6,250 % fällig am 15.08.2024 | 4.000 | 4.204 | 0,15 |
| **NVA Holdings, Inc.** | | | |
| 6,875 % fällig am 01.04.2026 | 8.500 | 8.925 | 0,31 |
| **Open Text Corp.** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2026 | 2.500 | 2.651 | 0,09 |
| **Ortho-Clinical Diagnostics, Inc.** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.05.2022 | 32.750 | 31.440 | 1,09 |
| **Pacific Drilling SA** | | | |
| 8,375 % fällig am 01.10.2023 | 5.250 | 5.224 | 0,18 |
| **Pactiv LLC** | | | |
| 8,375 % fällig am 15.04.2027 | 500 | 545 | 0,02 |
| **Panther BF Aggregator 2 LP** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.05.2026 | 3.000 | 3.124 | 0,11 |
| 8,500 % fällig am 15.05.2027 | 3.000 | 3.097 | 0,11 |
| **Par Pharmaceutical, Inc.** | | | |
| 7,500 % fällig am 01.04.2027 | 1.500 | 1.478 | 0,05 |
| **Park-Ohio Industries, Inc.** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.04.2027 | 2.400 | 2.412 | 0,08 |
| **Party City Holdings, Inc.** | | | |
| 6,125 % fällig am 15.08.2023 | 2.000 | 2.020 | 0,07 |
| 6,625 % fällig am 01.08.2026 | 2.500 | 2.431 | 0,08 |
| **PDC Energy, Inc.** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.05.2026 | 5.750 | 5.664 | 0,20 |
| 6,125 % fällig am 15.09.2024 | 2.000 | 2.005 | 0,07 |
| **PetSmart, Inc.** | | | |
| 5,875 % fällig am 01.06.2025 | 2.750 | 2.681 | 0,09 |
| 7,125 % fällig am 15.03.2023 | 8.500 | 8.011 | 0,28 |
| **PGT Escrow Issuer, Inc.** | | | |
| 6,750 % fällig am 01.08.2026 | 2.500 | 2.653 | 0,09 |
| **Pilgrim's Pride Corp.** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.03.2025 | 4.750 | 4.833 | 0,17 |
| 5,875 % fällig am 30.09.2027 | 3.000 | 3.120 | 0,11 |
| **Pinnacle Operating Corp.** | | | |
| 9,000 % fällig am 15.05.2023 | 371 | 126 | 0,00 |
| **Polaris Intermediate Corp. (8,500 % PIK)** | | | |
| 8,500 % fällig am 01.12.2022 (b) | 3.125 | 2.773 | 0,10 |
| **Post Holdings, Inc.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2026 | $ 10.000 | $ 10.175 | 0,35 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | 2.000 | 2.073 | 0,07 |
| 5,625 % fällig am 15.01.2028 | 4.000 | 4.125 | 0,14 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | 7.000 | 7.262 | 0,25 |
| **PQ Corp.** | | | |
| 5,750 % fällig am 15.12.2025 | 1.500 | 1.524 | 0,05 |
| 6,750 % fällig am 15.11.2022 | 1.500 | 1.559 | 0,05 |
| **Prestige Brands, Inc.** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.12.2021 | 5.000 | 5.044 | 0,17 |
| 6,375 % fällig am 01.03.2024 | 2.500 | 2.628 | 0,09 |
| **Prime Security Services Borrower LLC** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.04.2024 | 3.750 | 3.825 | 0,13 |
| 9,250 % fällig am 15.05.2023 | 1.773 | 1.865 | 0,06 |
| **Rackspace Hosting, Inc.** | | | |
| 8,625 % fällig am 15.11.2024 (i) | 4.750 | 4.382 | 0,15 |
| **Radiate Holdco LLC** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.02.2025 | 4.500 | 4.376 | 0,15 |
| 6,875 % fällig am 15.02.2023 | 7.250 | 7.286 | 0,25 |
| **Range Resources Corp.** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.05.2025 | 2.000 | 1.765 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | 3.000 | 2.861 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 15.03.2023 | 1.250 | 1.183 | 0,04 |
| **RBS Global, Inc.** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.12.2025 | 6.500 | 6.614 | 0,23 |
| **Refinitiv U.S. Holdings, Inc.** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2026 | € 4.000 | 4.671 | 0,16 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2026 | $ 3.500 | 3.608 | 0,12 |
| 6,875 % fällig am 15.11.2026 | € 2.500 | 2.905 | 0,10 |
| 8,250 % fällig am 15.11.2026 | $ 11.000 | 11.341 | 0,39 |
| **RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.** | | | |
| 8,250 % fällig am 01.05.2023 | 3.000 | 3.195 | 0,11 |
| **Revlon Consumer Products Corp.** | | | |
| 6,250 % fällig am 01.08.2024 | 1.750 | 1.208 | 0,04 |
| **Reynolds Group Issuer, Inc.** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.07.2023 | 1.500 | 1.532 | 0,05 |
| 5,750 % fällig am 15.10.2020 | 2.907 | 2.918 | 0,10 |
| 6,875 % fällig am 15.02.2021 | 1.040 | 1.044 | 0,04 |
| 7,000 % fällig am 15.07.2024 | 7.000 | 7.251 | 0,25 |
| **Rite Aid Corp.** | | | |
| 6,125 % fällig am 01.04.2023 | 5.000 | 4.237 | 0,15 |
| **Rivers Pittsburgh Borrower LP** | | | |
| 6,125 % fällig am 15.08.2021 | 2.000 | 2.035 | 0,07 |
| **Rowan Cos., Inc.** | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2024 | 3.000 | 2.295 | 0,08 |
| 4,875 % fällig am 01.06.2022 | 3.000 | 2.775 | 0,10 |
| 5,400 % fällig am 01.12.2042 | 500 | 293 | 0,01 |
| 5,850 % fällig am 15.01.2044 | 2.500 | 1.463 | 0,05 |
| 7,375 % fällig am 15.06.2025 | 2.000 | 1.560 | 0,05 |
| 7,875 % fällig am 01.08.2019 | 1.750 | 1.752 | 0,06 |
| **RP Crown Parent LLC** | | | |
| 7,375 % fällig am 15.10.2024 | 3.500 | 3.657 | 0,13 |
| **Scientific Games International, Inc.** | | | |
| 5,000 % fällig am 15.10.2025 | 4.750 | 4.809 | 0,17 |
| 6,250 % fällig am 01.09.2020 | 1.750 | 1.759 | 0,06 |
| 8,250 % fällig am 15.03.2026 | 2.500 | 2.631 | 0,09 |
| 10,000 % fällig am 01.12.2022 | 5.455 | 5.741 | 0,20 |
| **Sealed Air Corp.** | | | |
| 4,875 % fällig am 01.12.2022 | 1.000 | 1.053 | 0,04 |
| 5,125 % fällig am 01.12.2024 | 2.000 | 2.110 | 0,07 |
| 5,250 % fällig am 01.04.2023 | 2.000 | 2.110 | 0,07 |
| **Sensata Technologies BV** | | | |
| 4,875 % fällig am 15.10.2023 | 1.000 | 1.046 | 0,04 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2025 | 2.000 | 2.095 | 0,07 |
| 5,625 % fällig am 01.11.2024 | 2.000 | 2.165 | 0,07 |
| **Sensata Technologies UK Financing Co. PLC** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.02.2026 | 5.000 | 5.337 | 0,18 |
| **ServiceMaster Co. LLC** | | | |
| 7,450 % fällig am 15.08.2027 | 4.580 | 4.929 | 0,17 |
| **Shelf Drilling Holdings Ltd.** | | | |
| 8,250 % fällig am 15.02.2025 | 4.000 | 3.712 | 0,13 |
| **Sigma Holdco BV** | | | |
| 7,875 % fällig am 15.05.2026 | 8.500 | 7.905 | 0,27 |
| **Simmons Foods, Inc.** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.11.2024 | 6.000 | 5.490 | 0,19 |
| 7,750 % fällig am 15.01.2024 | 1.250 | 1.353 | 0,05 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US High Yield Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Sinclair Television Group, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2027 | $ | 4.000 | $ 3.940 | 0,14 |
| 5,625 % fällig am 01.08.2024 | | 2.000 | 2.050 | 0,07 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2026 | | 1.000 | 1.026 | 0,04 |
| **Sirius XM Radio, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2027 | | 2.000 | 2.042 | 0,07 |
| 5,375 % fällig am 15.04.2025 | | 2.500 | 2.587 | 0,09 |
| 5,500 % fällig am 01.07.2029 | | 2.250 | 2.312 | 0,08 |
| 6,000 % fällig am 15.07.2024 | | 2.000 | 2.063 | 0,07 |
| **Sophia LP** | | | | |
| 9,000 % fällig am 30.09.2023 | | 8.500 | 8.808 | 0,30 |
| **Sotera Health Holdings LLC** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.05.2023 | | 7.000 | 7.105 | 0,25 |
| **Sotera Health Topco, Inc. (8,125 % bar oder 8,875 % PIK)** | | | | |
| 8,125 % fällig am 01.11.2021 (b) | | 15.000 | 15.000 | 0,52 |
| **Southwestern Energy Co.** | | | | |
| 6,200 % fällig am 23.01.2025 | | 2.000 | 1.835 | 0,06 |
| 7,500 % fällig am 01.04.2026 | | 5.000 | 4.762 | 0,16 |
| **Spectrum Brands, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.07.2025 | | 2.500 | 2.609 | 0,09 |
| 6,125 % fällig am 15.12.2024 | | 1.500 | 1.553 | 0,05 |
| **SPX FLOW, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.08.2024 | | 3.500 | 3.666 | 0,13 |
| 5,875 % fällig am 15.08.2026 | | 5.000 | 5.275 | 0,18 |
| **SRC Energy, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 01.12.2025 | | 7.000 | 6.405 | 0,22 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | 4.975 | 0,17 |
| 5,000 % fällig am 15.02.2027 | | 2.500 | 2.538 | 0,09 |
| 5,375 % fällig am 15.11.2024 | | 5.000 | 5.194 | 0,18 |
| 6,000 % fällig am 15.10.2025 | | 6.000 | 6.397 | 0,22 |
| **Staples, Inc.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2026 | | 7.000 | 6.976 | 0,24 |
| 10,750 % fällig am 15.04.2027 | | 3.000 | 2.992 | 0,10 |
| **Starfruit Finco BV** | | | | |
| 6,500 % fällig am 01.10.2026 | € | 5.000 | 5.774 | 0,20 |
| 8,000 % fällig am 01.10.2026 (i) | $ | 5.000 | 5.162 | 0,18 |
| **Stars Group Holdings BV** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.07.2026 | | 2.250 | 2.385 | 0,08 |
| **Station Casinos LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.10.2025 | | 3.000 | 3.015 | 0,10 |
| **Steel Dynamics, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2021 | | 3.500 | 3.541 | 0,12 |
| **Stericycle, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.07.2024 | | 3.000 | 3.139 | 0,11 |
| **Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.05.2025 | | 2.650 | 2.617 | 0,09 |
| **Sunoco LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.01.2023 | | 1.750 | 1.792 | 0,06 |
| 5,500 % fällig am 15.02.2026 | | 1.000 | 1.044 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 15.03.2028 | | 1.000 | 1.039 | 0,04 |
| **T-Mobile USA, Inc.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.02.2026 | | 2.000 | 2.055 | 0,07 |
| 4,750 % fällig am 01.02.2028 | | 2.750 | 2.840 | 0,10 |
| 5,125 % fällig am 15.04.2025 | | 1.500 | 1.567 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 01.03.2023 | | 1.000 | 1.025 | 0,04 |
| 6,375 % fällig am 01.03.2025 | | 4.000 | 4.164 | 0,14 |
| 6,500 % fällig am 15.01.2026 | | 4.500 | 4.876 | 0,17 |
| **Team Health Holdings, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.02.2025 (i) | | 11.500 | 8.855 | 0,31 |
| **TEGNA, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.09.2024 | | 1.500 | 1.545 | 0,05 |
| 6,375 % fällig am 15.10.2023 | | 2.000 | 2.068 | 0,07 |
| **Teine Energy Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 30.09.2022 | | 4.000 | 4.090 | 0,14 |
| **Tempo Acquisition LLC** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.06.2025 | | 10.000 | 10.350 | 0,36 |
| **Tempur Sealy International, Inc.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.06.2026 | | 2.500 | 2.603 | 0,09 |
| **Tenet Healthcare Corp.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 01.10.2021 | | 2.000 | 2.043 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 01.05.2025 | | 3.500 | 3.526 | 0,12 |
| 6,750 % fällig am 15.06.2023 | | 10.000 | 10.075 | 0,35 |
| 6,875 % fällig am 15.11.2031 | | 2.500 | 2.219 | 0,08 |
| 7,000 % fällig am 01.08.2025 (i) | | 5.000 | 5.000 | 0,17 |
| 8,125 % fällig am 01.04.2022 | | 11.500 | 12.104 | 0,42 |
| **TransDigm, Inc.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.07.2022 | $ | 3.750 | $ 3.797 | 0,13 |
| 6,250 % fällig am 15.03.2026 | | 2.500 | 2.637 | 0,09 |
| 6,375 % fällig am 15.06.2026 | | 5.000 | 5.056 | 0,17 |
| 6,500 % fällig am 15.07.2024 | | 5.000 | 5.075 | 0,18 |
| 6,500 % fällig am 15.05.2025 | | 2.500 | 2.538 | 0,09 |
| **Transocean Guardian Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2024 | | 3.071 | 3.137 | 0,11 |
| **Transocean, Inc.** | | | | |
| 6,800 % fällig am 15.03.2038 | | 6.000 | 4.530 | 0,16 |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 5.750 | 5.470 | 0,19 |
| 7,500 % fällig am 15.01.2026 | | 2.000 | 1.915 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 15.04.2031 | | 7.000 | 5.985 | 0,21 |
| 9,000 % fällig am 15.07.2023 | | 7.000 | 7.481 | 0,26 |
| **TreeHouse Foods, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 15.03.2022 | | 1.000 | 1.011 | 0,03 |
| 6,000 % fällig am 15.02.2024 | | 3.000 | 3.127 | 0,11 |
| **Trident Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 6,625 % fällig am 01.11.2025 | | 4.250 | 3.984 | 0,14 |
| **Triumph Group, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.04.2021 | | 2.000 | 1.980 | 0,07 |
| 7,750 % fällig am 15.08.2025 | | 4.000 | 3.880 | 0,13 |
| **U.S. Concrete, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.06.2024 | | 4.000 | 4.180 | 0,14 |
| **U.S. Foods, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.06.2024 | | 2.500 | 2.578 | 0,09 |
| **United Rentals North America, Inc.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.10.2025 | | 2.250 | 2.292 | 0,08 |
| 5,500 % fällig am 15.07.2025 | | 3.000 | 3.131 | 0,11 |
| 5,500 % fällig am 15.05.2027 | | 3.000 | 3.165 | 0,11 |
| 5,875 % fällig am 15.09.2026 | | 1.000 | 1.069 | 0,04 |
| 6,500 % fällig am 15.12.2026 | | 2.500 | 2.712 | 0,09 |
| **Unitymedia GmbH** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.01.2025 | | 5.000 | 5.226 | 0,18 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.01.2025 | | 3.000 | 3.105 | 0,11 |
| **Univar USA, Inc.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 15.07.2023 | | 5.000 | 5.119 | 0,18 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.05.2023 | | 5.750 | 5.649 | 0,20 |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | | 10.000 | 9.562 | 0,33 |
| 6,750 % fällig am 15.09.2022 | | 1.019 | 1.040 | 0,04 |
| **UPC Holding BV** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | | 4.750 | 4.786 | 0,17 |
| **UPCB Finance Ltd.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2025 | | 4.750 | 4.894 | 0,17 |
| **Verscend Escrow Corp.** | | | | |
| 9,750 % fällig am 15.08.2026 | | 2.500 | 2.606 | 0,09 |
| **ViaSat, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.09.2025 | | 4.000 | 3.950 | 0,14 |
| **Viking Cruises Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.09.2027 | | 6.825 | 6.927 | 0,24 |
| **Virgin Media Finance PLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2025 | | 4.000 | 4.155 | 0,14 |
| 6,000 % fällig am 15.10.2024 | | 1.000 | 1.040 | 0,04 |
| **Virgin Media Secured Finance PLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2026 | | 5.500 | 5.657 | 0,20 |
| **Vizient, Inc.** | | | | |
| 6,250 % fällig am 15.05.2027 | | 6.000 | 6.353 | 0,22 |
| **VOC Escrow Ltd.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.02.2028 | | 2.250 | 2.292 | 0,08 |
| **Wabash National Corp.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2025 | | 4.750 | 4.524 | 0,16 |
| **Weatherford International Ltd.** | | | | |
| 7,000 % fällig am 15.03.2038 ^ | | 2.750 | 1.416 | 0,05 |
| 8,250 % fällig am 15.06.2023 ^ | | 3.000 | 1.583 | 0,05 |
| 9,875 % fällig am 15.02.2024 ^ | | 3.000 | 1.583 | 0,05 |
| **Welbilt, Inc.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 15.02.2024 | | 3.000 | 3.259 | 0,11 |
| **West Street Merger Sub, Inc.** | | | | |
| 6,375 % fällig am 01.09.2025 | | 15.000 | 13.950 | 0,48 |
| **Whiting Petroleum Corp.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.03.2021 | | 1.500 | 1.517 | 0,05 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2026 | | 1.000 | 969 | 0,03 |
| **Williams Scotsman International, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.08.2023 | | 6.000 | 6.270 | 0,22 |
| **Wind Tre SpA** | | | | |
| 5,000 % fällig am 20.01.2026 | $ | 7.500 | $ 7.296 | 0,25 |
| **WMG Acquisition Corp.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2023 | | 1.750 | 1.792 | 0,06 |
| 5,500 % fällig am 15.04.2026 | | 2.750 | 2.846 | 0,10 |
| **WPX Energy, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.09.2024 | | 1.750 | 1.805 | 0,06 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2022 | | 2.000 | 2.095 | 0,07 |
| 8,250 % fällig am 01.08.2023 | | 1.000 | 1.145 | 0,04 |
| **WR Grace & Co-Conn** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.10.2021 | | 2.000 | 2.085 | 0,07 |
| 5,625 % fällig am 01.10.2024 | | 1.000 | 1.083 | 0,04 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.05.2027 | | 2.000 | 2.010 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 4.000 | 4.141 | 0,14 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 2.500 | 2.438 | 0,08 |
| **XPO Logistics, Inc.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 15.06.2022 | | 3.338 | 3.413 | 0,12 |
| **Yum! Brands, Inc.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.11.2037 | | 2.000 | 2.115 | 0,07 |
| **Zayo Group LLC** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.01.2027 | | 4.750 | 4.852 | 0,17 |
| 6,375 % fällig am 15.05.2025 | | 1.000 | 1.024 | 0,04 |
| **Zekelman Industries, Inc.** | | | | |
| 9,875 % fällig am 15.06.2023 | | 6.000 | 6.337 | 0,22 |
| **Ziggo Bond Co. BV** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2025 | | 2.000 | 2.031 | 0,07 |
| 6,000 % fällig am 15.01.2027 | | 5.000 | 5.037 | 0,17 |
| **Ziggo BV** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2027 | | 4.500 | 4.600 | 0,16 |
| | | | 1.980.828 | 68,43 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **Antero Midstream Partners LP** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.09.2024 | | 1.250 | 1.248 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | | 1.000 | 1.003 | 0,04 |
| **Blue Racer Midstream LLC** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.11.2022 | | 4.500 | 4.584 | 0,16 |
| 6,625 % fällig am 15.07.2026 | | 2.000 | 2.025 | 0,07 |
| **Calpine Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2023 | | 7.750 | 7.859 | 0,27 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2025 | | 4.750 | 4.732 | 0,16 |
| **CenturyLink, Inc.** | | | | |
| 5,800 % fällig am 15.03.2022 | | 3.750 | 3.928 | 0,14 |
| 6,450 % fällig am 15.06.2021 | | 3.750 | 3.975 | 0,14 |
| **Covanta Holding Corp.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.03.2024 | | 1.500 | 1.549 | 0,05 |
| 5,875 % fällig am 01.07.2025 | | 1.500 | 1.566 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 01.01.2027 | | 2.000 | 2.100 | 0,07 |
| **CrownRock LP** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.10.2025 | | 5.250 | 5.283 | 0,18 |
| **Embarq Corp.** | | | | |
| 7,995 % fällig am 01.06.2036 | | 1.250 | 1.216 | 0,04 |
| **Endeavor Energy Resources LP** | | | | |
| 5,500 % fällig am 30.01.2026 | | 2.000 | 2.083 | 0,07 |
| 5,750 % fällig am 30.01.2028 | | 4.000 | 4.230 | 0,15 |
| **EP Energy LLC** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.05.2026 | | 2.250 | 2.019 | 0,07 |
| **Frontier Communications Corp.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 15.01.2025 (i) | | 2.000 | 1.130 | 0,04 |
| 8,000 % fällig am 01.04.2027 | | 1.250 | 1.303 | 0,05 |
| 8,500 % fällig am 01.04.2026 | | 3.000 | 2.917 | 0,10 |
| 10,500 % fällig am 15.09.2022 | | 5.000 | 3.412 | 0,12 |
| 11,000 % fällig am 15.09.2025 | | 2.000 | 1.250 | 0,04 |
| **Genesis Energy LP** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.05.2023 | | 2.000 | 1.990 | 0,07 |
| 6,250 % fällig am 15.05.2026 | | 1.000 | 970 | 0,03 |
| 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 3.250 | 3.189 | 0,11 |
| 6,750 % fällig am 01.08.2022 | | 4.000 | 4.050 | 0,14 |
| **Great Western Petroleum LLC** | | | | |
| 9,000 % fällig am 30.09.2021 | | 5.000 | 4.087 | 0,14 |
| **Jonah Energy LLC** | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.10.2025 (i) | | 4.000 | 1.950 | 0,07 |
| **NGL Energy Partners LP** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.03.2025 | | 1.500 | 1.493 | 0,05 |
| 7,500 % fällig am 01.11.2023 | | 2.000 | 2.100 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **NGPL PipeCo LLC** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.08.2022 | $ 1.625 | $ 1.682 | 0,06 |
| 4,875 % fällig am 15.08.2027 | 2.000 | 2.125 | 0,07 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.01.2027 | 2.750 | 2.997 | 0,10 |
| **NSG Holdings LLC** | | | |
| 7,750 % fällig am 15.12.2025 | 2.580 | 2.780 | 0,10 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** | | | |
| 2,450 % fällig am 15.08.2022 ^ | 3.500 | 3.377 | 0,12 |
| 3,300 % fällig am 01.12.2027 ^ | 1.000 | 953 | 0,03 |
| 3,500 % fällig am 01.10.2020 ^ | 1.000 | 980 | 0,03 |
| 4,250 % fällig am 01.08.2023 ^ | 1.000 | 1.008 | 0,04 |
| 5,125 % fällig am 15.11.2043 ^ | 375 | 386 | 0,01 |
| 6,050 % fällig am 01.03.2034 ^ | 2.000 | 2.240 | 0,08 |
| **Parsley Energy LLC** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.08.2025 | 1.000 | 1.020 | 0,04 |
| 5,375 % fällig am 15.01.2025 | 3.000 | 3.090 | 0,11 |
| 5,625 % fällig am 15.10.2027 | 4.000 | 4.200 | 0,15 |
| 6,250 % fällig am 01.06.2024 | 1.000 | 1.043 | 0,04 |
| **Sprint Capital Corp.** | | | |
| 6,875 % fällig am 15.11.2028 | 3.000 | 3.091 | 0,11 |
| 8,750 % fällig am 15.03.2032 | 4.750 | 5.510 | 0,19 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 6,000 % fällig am 15.11.2022 | 2.000 | 2.090 | 0,07 |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | 2.250 | 2.337 | 0,08 |
| **Sprint Corp.** | | | |
| 7,125 % fällig am 15.06.2024 | 7.000 | 7.440 | 0,26 |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | 9.000 | 9.585 | 0,33 |
| 7,625 % fällig am 15.02.2025 | 8.000 | 8.540 | 0,30 |
| 7,625 % fällig am 01.03.2026 | 3.000 | 3.205 | 0,11 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2023 | 12.500 | 13.609 | 0,47 |
| **Talen Energy Supply LLC** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.06.2025 | 2.750 | 2.317 | 0,08 |
| 6,625 % fällig am 15.01.2028 (a) | 1.000 | 998 | 0,03 |
| 7,250 % fällig am 15.05.2027 | 2.375 | 2.440 | 0,08 |
| 10,500 % fällig am 15.01.2026 | 3.000 | 3.000 | 0,10 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | |
| 5,500 % fällig am 15.09.2024 | 4.500 | 4.669 | 0,16 |
| 5,500 % fällig am 15.01.2028 | 1.750 | 1.778 | 0,06 |
| **Targa Resources Partners LP** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.11.2023 | 1.750 | 1.757 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 15.01.2028 | 3.000 | 3.015 | 0,10 |
| 5,250 % fällig am 01.05.2023 | 5.000 | 5.082 | 0,18 |
| 5,875 % fällig am 15.04.2026 | 2.000 | 2.128 | 0,07 |
| 6,875 % fällig am 15.01.2029 | 2.000 | 2.222 | 0,08 |
| **Telecom Italia Capital S.A.** | | | |
| 6,375 % fällig am 15.11.2033 | 3.750 | 3.909 | 0,14 |
| 7,200 % fällig am 18.07.2036 | 2.000 | 2.215 | 0,08 |
| **Telecom Italia SpA** | | | |
| 5,303 % fällig am 30.05.2024 | 4.750 | 4.934 | 0,17 |
| **TerraForm Power Operating LLC** | | | |
| 4,250 % fällig am 31.01.2023 | 3.000 | 3.011 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 31.01.2028 | 3.750 | 3.778 | 0,13 |
| 6,625 % fällig am 15.06.2025 | 2.000 | 2.108 | 0,07 |
| **Transocean Sentry Ltd.** | | | |
| 5,375 % fällig am 15.05.2023 | 3.850 | 3.864 | 0,13 |
| **Vistra Energy Corp.** | | | |
| 7,625 % fällig am 01.11.2024 | $ 4.000 | $ 4.240 | 0,15 |
| **Vistra Operations Co. LLC** | | | |
| 5,000 % fällig am 31.07.2027 | 4.000 | 4.155 | 0,14 |
| 5,625 % fällig am 15.02.2027 | 2.750 | 2.922 | 0,10 |
| | | 227.071 | 7,84 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | 2.381.706 | 82,28 |
| **WANDELANLEIHEN & WECHSEL** | | | |
| **CHC Group LLC** | | | |
| 0,000 % fällig am 01.10.2020 (d)(h) | 538 | 167 | 0,01 |
| **Denbury Resources, Inc.** | | | |
| 6,375 % fällig am 31.12.2024 | 805 | 523 | 0,01 |
| | | 690 | 0,02 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Banc of America Funding Trust** | | | |
| 4,349 % fällig am 20.02.2036 ^ | 168 | 163 | 0,01 |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 2,613 % fällig am 20.05.2046 ^ | 99 | 84 | 0,00 |
| **Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust** | | | |
| 2,754 % fällig am 25.02.2036 ^ | 31 | 8 | 0,00 |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | 33 | 30 | 0,00 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,863 % fällig am 25.02.2037 ^ | 427 | 200 | 0,01 |
| **Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust** | | | |
| 5,500 % fällig am 25.12.2035 ^ | 78 | 77 | 0,00 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,763 % fällig am 25.04.2035 | 5 | 5 | 0,00 |
| **IndyMac Mortgage Loan Trust** | | | |
| 6,000 % fällig am 25.07.2037 ^ | 322 | 317 | 0,01 |
| **MortgageIT Trust** | | | |
| 3,044 % fällig am 25.02.2035 | 109 | 110 | 0,00 |
| **Residential Accredit Loans, Inc. Trust** | | | |
| 2,674 % fällig am 25.05.2046 ^ | 162 | 144 | 0,01 |
| **TBW Mortgage-Backed Trust** | | | |
| 5,970 % fällig am 25.09.2036 ^ | 662 | 57 | 0,00 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 3,683 % fällig am 25.12.2036 ^ | 305 | 290 | 0,01 |
| 3,915 % fällig am 25.10.2036 ^ | 182 | 178 | 0,01 |
| | | 1.663 | 0,06 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | |
| **Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust** | | | |
| 2,474 % fällig am 25.01.2037 ^ | 94 | 40 | 0,00 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **INVESTMENTFONDS** | | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)** | 482.160 | 5.111 | 0,18 |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (f)** | 10.252.495 | $ 103.448 | 3,57 |
| | | 108.559 | 3,75 |
| **STAMMAKTIEN** | | | |
| **KOMMUNIKATIONSDIENSTE** | | | |
| **Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)** | 167.378 | 790 | 0,03 |
| **iHeartMedia, Inc. (c)** | 59.357 | 893 | 0,03 |
| **iHeartMedia, Inc. 'A' (c)** | 9.114 | 137 | 0,00 |
| **iHeartMedia, Inc. 'B' (c)** | 122 | 2 | 0,00 |
| | | 1.822 | 0,06 |
| **ENERGIE** | | | |
| **CHC Group LLC (c)** | 10.468 | 11 | 0,00 |
| **FINANZEN** | | | |
| **DB Investors, Inc. (c)(h)** | 3.646 | 15 | 0,00 |
| **GESUNDHEITSWESEN** | | | |
| **Advanz Pharma Corp. (c)** | 12.587 | 206 | 0,01 |
| | | 2.054 | 0,07 |
| **OPTIONSSCHEINE** | | | |
| **DB Investors, Inc. - Exp. 28.06.2069 (h)** | 10.417 | 0 | 0,00 |
| **VORZUGSWERTPAPIERE** | | | |
| **Pinnacle Agriculture Holdings LLC** | | | |
| 3,000 % (h) | 379.358 | 178 | 0,01 |
| **Sequa Corp.** | | | |
| 9,000 % | 2.965 | 3.161 | 0,11 |
| | | 3.339 | 0,12 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTO-VERMÖGENS |
|---|---|---|---|
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (j)** | | | |
| | | 389.909 | 13,47 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | 389.909 | 13,47 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 2.895.300** | **100,02** |

**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**

**VERKAUFSOPTIONEN**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Aufgeld | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note August 2019 Futures | $ 116,750 | 26.07.2019 | 185 | $ (36) | $ (7) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note August 2019 Futures | 118,250 | 26.07.2019 | 185 | (37) | (68) | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 124,000 | 26.07.2019 | 215 | (50) | (3) | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 125,500 | 26.07.2019 | 187 | (60) | (9) | 0,00 |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 127,000 | 26.07.2019 | 215 | (77) | (262) | (0,01) |
| Call - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note August 2019 Futures | 129,000 | 26.07.2019 | 187 | (60) | (50) | 0,00 |
| | | | | $ (320) | $ (399) | (0,01) |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ (399)** | **(0,01)** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

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

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-31 5-Year Index | 5,000 % | 20.12.2023 | $ 63.050 | $ 2.223 | 0,08 |
| CDX.HY-32 5-Year Index | 5,000 | 20.06.2024 | 50.000 | 287 | 0,01 |
| | | | | $ 2.510 | 0,09 |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | **$ 2.510** | **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) 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 | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 5.000 | 20.09.2019 | $ (31) | $ 80 | $ 49 | 0,00 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 10.000 | 20.12.2019 | (64) | 153 | 89 | 0,00 |
| FBF | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 10.000 | 20.09.2019 | (17) | 191 | 174 | 0,01 |
| GST | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR | 40.000 | 20.09.2019 | (239) | 2.027 | 1.788 | 0,06 |
| JPM | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 30.000 | 20.09.2019 | (175) | 824 | 649 | 0,02 |
| | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | 5.000 | 20.12.2019 | (29) | 130 | 101 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (555) | $ 3.405 | $ 2.850 | 0,09 |

**DEVISENTERMINKONTRAKTE**

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | 07/2019 | € 2.052 | $ 2.340 | $ 3 | $ 0 | $ 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ 342.900 | 3.149 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| BRC | 07/2019 | € 17.877 | 19.994 | 0 | (365) | (365) | (0,01) |
| CBK | 07/2019 | 514 | 584 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ 3.126 | 3.958 | 0 | (20) | (20) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 21.839 | € 19.216 | 45 | 0 | 45 | 0,00 |
| | 08/2019 | € 19.216 | $ 21.895 | 0 | (44) | (44) | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 512 | 582 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 208 | € 183 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | 5 | £ 4 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | 1.387 | € 1.227 | 10 | 0 | 10 | 0,00 |
| SCX | 08/2019 | 3.106 | ¥ 334.500 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| | | | | $ 67 | $ (476) | $ (409) | (0,01) |

**ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE**

Zum 30. Juni 2019 standen für die Institutional EUR (Hedged) thesaurierend, Institutional EUR (Hedged) ausschüttend, Investor EUR (Hedged) thesaurierend und Class E EUR (Hedged) thesaurierend die folgenden Devisenterminkontrakte aus:

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 188.490 | $ 214.200 | $ 0 | $ (452) | $ (452) | (0,02) |
| | 08/2019 | $ 214.746 | € 188.490 | 455 | 0 | 455 | 0,02 |
| BPS | 07/2019 | € 176.694 | $ 200.899 | 1 | (321) | (320) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 323 | € 286 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| | 08/2019 | 200.913 | 176.255 | 319 | 0 | 319 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | 206.479 | 184.622 | 3.769 | 0 | 3.769 | 0,13 |
| CBK | 07/2019 | € 189.088 | $ 214.899 | 0 | (435) | (435) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 1.988 | € 1.751 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08/2019 | 214.766 | 188.490 | 436 | 0 | 436 | 0,02 |

| Kontrahent | Abrechnungsmonat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| GLM | 07/2019 | $ 7.551 | € 6.724 | $ 106 | $ 0 | $ 106 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 206.445 | 184.622 | 3.802 | 0 | 3.802 | 0,13 |
| RBC | 07/2019 | 183 | 161 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € 9.835 | $ 11.049 | 0 | (151) | (151) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 162 | € 143 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | € 286 | $ 324 | 0 | (2) | (2) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 3.086 | € 2.761 | 59 | 0 | 59 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | 206.446 | 184.622 | 3.802 | 0 | 3.802 | 0,13 |
| | | | | $ 12.760 | $ (1.361) | $ 11.399 | 0,39 |

Zum 30. Juni 2019 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 | 07/2019 | £ 1.401 | $ 1.764 | $ 0 | $ (19) | $ (19) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 924 | £ 730 | 5 | 0 | 5 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | £ 34.703 | $ 44.015 | 0 | (150) | (150) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 167 | £ 132 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | 44.083 | 34.703 | 152 | 0 | 152 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | £ 34.520 | $ 43.861 | 0 | (73) | (73) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 43.796 | £ 34.566 | 196 | 0 | 196 | 0,01 |
| | 08/2019 | 43.928 | 34.520 | 74 | 0 | 74 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | £ 1.121 | $ 1.418 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 143 | £ 113 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | 66 | 52 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | 43.750 | 34.566 | 242 | 0 | 242 | 0,01 |
| SSB | 07/2019 | 43.571 | 34.483 | 315 | 0 | 315 | 0,01 |
| | | | | $ 985 | $ (252) | $ 733 | 0,03 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 14.573** | **0,50** |
| **Summe Anlagen** | **$ 2.911.984** | **100,60** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (17.271)** | **(0,60)** |
| **Nettovermögen** | **$ 2.894.713** | **100,00** |

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

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

**^ Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a) Wertpapier per Emissionstermin.**

**(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.**

**(c) Das Wertpapier hat in den letzten zwölf Monaten keine Erträge geliefert.**

**(d) Nullkuponwertpapier.**

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

**(f) Mit dem Fonds verbunden.**

**(g) Bedingt wandelbares Wertpapier.**

**(h) Eingeschränkte Wertpapiere**

| Emittentenbeschreibung | Kaufdatum | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|
| CHC Group LLC 0,000 % fällig am 01.10.2020 | 27.03.2017 | $ 473 | $ 167 | 0,01 |
| DB Investors, Inc. - Exp. 28.06.2069 | 18.02.2015 | 0 | 0 | 0,00 |
| DB Investors, Inc. | 18.02.2015 | 15 | 15 | 0,00 |
| Pinnacle Agriculture Holdings LLC 3,000 % | 10.03.2017 | 380 | 178 | 0,01 |
| | | $ 868 | $ 360 | 0,02 |

**(i) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 33.458 und Barmittel in Höhe von USD 968 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 269 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 6.441 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 50 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(j) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kapitalbetrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensionsgeschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensionsgeschäft[1] | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 2,800 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 80.000 | U.S. Treasury Bonds 3,000 % - 3,750 % fällig am 15.11.2043 - 15.11.2044 | $ (82.172) | $ 80.000 | $ 80.019 | 2,77 |
| BSN | 2,520 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 46.100 | U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 15.05.2024 | (47.086) | 46.100 | 46.110 | 1,59 |
| FICC | 2,000 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 11.609 | U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2021 | (11.844) | 11.609 | 11.611 | 0,40 |
| JPS | 2,500 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 30.000 | U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 31.01.2021 | (30.625) | 30.000 | 30.006 | 1,04 |
| NOM | 2,700 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 46.100 | U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 31.05.2020 | (47.061) | 46.100 | 46.110 | 1,59 |
| RDR | 2,550 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 58.900 | U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 15.05.2022 | (60.174) | 58.900 | 58.913 | 2,04 |
| RVM | 2,800 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 25.000 | U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 15.05.2022 | (25.539) | 25.000 | 25.006 | 0,86 |
| SGY | 2,570 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 46.100 | U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 15.01.2022 | (47.045) | 46.100 | 46.110 | 1,59 |
| TDM | 2,600 | 28.06.2019 | 01.07.2019 | 46.100 | U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 | (47.157) | 46.100 | 46.110 | 1,59 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (398.703)** | **$ 389.909** | **$ 389.995** | **13,47** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 109.693 | $ 2.780.496 | $ 5.111 | $ 2.895.300 |
| Finanzderivate[3] | (399) | 17.083 | 0 | 16.684 |
| **Summen** | **$ 109.294** | **$ 2.797.579** | **$ 5.111** | **$ 2.911.984** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 102.167 | $ 2.420.515 | $ 2.129 | $ 2.524.811 |
| Finanzderivate[3] | (307) | (1.319) | 0 | (1.626) |
| **Summen** | **$ 101.860** | **$ 2.419.196** | **$ 2.129** | **$ 2.523.185** |

[1] Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

[2] Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

[3] Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungsdatum | Fälligkeitsdatum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensionsgeschäften | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BCY | 1,450 % | 24.06.2019 | TBD[1] | $ (963) | $ (963) | (0,03) |
| | 2,000 | 19.03.2019 | TBD[1] | (2.751) | (2.767) | (0,10) |
| | 2,250 | 21.05.2019 | TBD[1] | (1.087) | (1.090) | (0,04) |
| | 2,300 | 28.01.2019 | TBD[1] | (1.898) | (1.917) | (0,07) |
| BRC | (0,500) | 21.03.2019 | TBD[1] | (2.008) | (2.005) | (0,07) |
| | 0,000 | 13.12.2018 | TBD[1] | (2.361) | (2.361) | (0,08) |
| | 0,000 | 07.02.2019 | TBD[1] | (4.406) | (4.406) | (0,15) |
| | 1,000 | 24.12.2018 | TBD[1] | (2.533) | (2.546) | (0,09) |
| | 1,350 | 21.06.2019 | TBD[1] | (2.797) | (2.798) | (0,10) |
| | 1,500 | 22.01.2019 | TBD[1] | (8.119) | (8.171) | (0,28) |
| | 2,350 | 24.12.2018 | TBD[1] | (2.648) | (2.681) | (0,09) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (31.705)** | **(1,10)** |

[1] Umgekehrtes Pensionsgeschäft mit offener Laufzeit.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (11) | $ 0 | $ (11) |
| BPS | (36) | 50 | 14 |
| BRC | 3.542 | (3.380) | 162 |
| CBK | 183 | 0 | 183 |
| FBF | 174 | 0 | 174 |
| GLM | 96 | 0 | 96 |
| GST | 1.788 | (1.660) | 128 |
| HUS | (1) | 0 | (1) |
| JPM | 760 | (860) | (100) |
| MYI | 3.802 | (3.470) | 332 |
| RBC | 1 | 0 | 1 |
| SCX | 101 | 0 | 101 |
| SSB | 372 | (280) | 92 |
| TOR | 3.802 | (3.590) | 212 |

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

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 41,37 | 36,99 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 45,18 | 57,65 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 13,47 | 6,50 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | (0,01) | (0,01) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | 0,09 | (0,05) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,50 | (0,01) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (1,10) | (3,08) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 0,25 | 0,26 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 82,28 | 90,11 |
| Wandelanleihen & Wechsel | 0,02 | 0,02 |
| Kommunalanleihen und Wechsel | 0,00 | 0,01 |
| Non-Agency-MBS | 0,06 | 0,07 |
| Investmentfonds | 3,75 | 4,08 |
| Stammaktien | 0,07 | 0,01 |
| Vorzugswertpapiere | 0,12 | 0,08 |
| Kurzfristige Instrumente | 13,47 | 6,50 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Optionen auf börsengehandelte Terminkontrakte | (0,01) | (0,01) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,09 | (0,05) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,09 | (0,05) |
| Devisenterminkontrakte | (0,01) | 0,00 |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,42 | 0,04 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (0,60) | (1,07) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Altra Industrial Motion Corp.** | | | | |
| 4,402 % fällig am 01.10.2025 | $ | 95 | $ 93 | 0,03 |
| **Axalta Coating Systems U.S. Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,080 % fällig am 01.06.2024 | | 198 | 197 | 0,07 |
| **Brand Energy & Infrastructure Services, Inc.** | | | | |
| 6,580 % - 6,842 % fällig am 21.06.2024 | | 98 | 95 | 0,03 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 4,330 % fällig am 30.04.2025 | | 298 | 298 | 0,10 |
| **Diamond Resorts Corp.** | | | | |
| 6,152 % fällig am 02.09.2023 | | 198 | 188 | 0,07 |
| **Envision Healthcare Corp.** | | | | |
| 6,152 % fällig am 10.10.2025 | | 100 | 87 | 0,03 |
| **Intelsat Jackson Holdings S.A.** | | | | |
| 6,154 % fällig am 27.11.2023 | | 200 | 198 | 0,07 |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | | |
| 4,152 % fällig am 27.03.2025 | | 2.259 | 2.246 | 0,78 |
| **Level 3 Financing, Inc.** | | | | |
| 4,652 % fällig am 22.02.2024 | | 1.100 | 1.092 | 0,38 |
| **MH Sub LLC** | | | | |
| 6,152 % fällig am 13.09.2024 | | 197 | 193 | 0,07 |
| **NCI Building Systems, Inc.** | | | | |
| 6,354 % fällig am 12.04.2025 | | 299 | 292 | 0,10 |
| **SS&C Technologies Holdings Europe SARL** | | | | |
| 4,652 % fällig am 16.04.2025 | | 22 | 22 | 0,01 |
| **SS&C Technologies, Inc.** | | | | |
| 4,652 % fällig am 16.04.2025 | | 132 | 131 | 0,05 |
| **TEX Operations Co. LLC** | | | | |
| 4,402 % fällig am 04.08.2023 | | 68 | 68 | 0,02 |
| **U.S. Foods, Inc.** | | | | |
| 4,402 % fällig am 27.06.2023 | | 198 | 197 | 0,07 |
| **Wyndham Hotels & Resorts, Inc.** | | | | |
| 4,152 % fällig am 30.05.2025 | | 99 | 99 | 0,03 |
| | | | 5.496 | 1,91 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BANKEN UND FINANZEN** | | | | |
| **ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC** | | | | |
| 2,626 % fällig am 28.04.2020 | € | 100 | 115 | 0,04 |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 3,650 % fällig am 21.07.2027 | $ | 520 | 518 | 0,18 |
| 4,125 % fällig am 03.07.2023 | | 800 | 833 | 0,29 |
| 4,450 % fällig am 01.10.2025 | | 500 | 528 | 0,18 |
| 4,450 % fällig am 03.04.2026 | | 400 | 422 | 0,15 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 500 | 513 | 0,18 |
| **AIB Group PLC** | | | | |
| 4,263 % fällig am 10.04.2025 | | 900 | 927 | 0,32 |
| 4,750 % fällig am 12.10.2023 | | 200 | 210 | 0,07 |
| **Air Lease Corp.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.03.2025 | | 900 | 906 | 0,31 |
| **Aircastle Ltd.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 25.09.2023 | | 200 | 208 | 0,07 |
| **Alexandria Real Estate Equities, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.04.2026 | | 200 | 210 | 0,07 |
| 3,950 % fällig am 15.01.2028 | | 200 | 211 | 0,07 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | |
| 8,000 % fällig am 01.11.2031 | | 300 | 398 | 0,14 |
| **Ambac LSNI LLC** | | | | |
| 7,319 % fällig am 12.02.2023 | | 179 | 182 | 0,06 |
| **American Campus Communities Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,300 % fällig am 15.07.2026 | | 300 | 303 | 0,10 |
| **American Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.08.2026 | | 200 | 201 | 0,07 |
| **American Homes 4 Rent LP** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.02.2028 | | 500 | 519 | 0,18 |
| **American International Group, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.04.2026 | | 200 | 209 | 0,07 |
| **American Tower Corp.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2027 | | 200 | 199 | 0,07 |
| 3,375 % fällig am 15.05.2024 | | 500 | 515 | 0,18 |
| 3,375 % fällig am 15.10.2026 | | 700 | 713 | 0,25 |
| 3,500 % fällig am 31.01.2023 | | 200 | 207 | 0,07 |
| **Arch Capital Finance LLC** | | | | |
| 4,011 % fällig am 15.12.2026 | $ | 400 | $ 430 | 0,15 |
| **Aroundtown S.A.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 1.200 | 1.299 | 0,45 |
| **Assurant, Inc.** | | | | |
| 3,583 % fällig am 26.03.2021 | | 200 | 200 | 0,07 |
| **Athene Global Funding** | | | | |
| 3,826 % fällig am 01.07.2022 | | 200 | 202 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 25.01.2022 | | 100 | 103 | 0,04 |
| **Athene Holding Ltd.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 12.01.2028 | | 100 | 101 | 0,04 |
| **AvalonBay Communities, Inc.** | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.05.2027 | | 300 | 312 | 0,11 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.11.2027 | | 400 | 401 | 0,14 |
| 4,875 % fällig am 01.10.2025 | | 100 | 108 | 0,04 |
| **AXA Equitable Holdings, Inc.** | | | | |
| 4,350 % fällig am 20.04.2028 | | 300 | 316 | 0,11 |
| **Axis Bank Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 21.05.2020 | | 200 | 200 | 0,07 |
| **AXIS Specialty Finance PLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 06.12.2027 | | 200 | 205 | 0,07 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 24.09.2023 (d)(f) | € | 400 | 472 | 0,16 |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 (d)(f) | | 200 | 240 | 0,08 |
| **Banco BTG Pactual S.A.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 31.01.2023 | $ | 500 | 521 | 0,18 |
| **Banco General S.A.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 07.08.2027 | | 200 | 203 | 0,07 |
| **Banco Mercantil del Norte S.A.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 27.09.2024 (d)(f) | | 500 | 500 | 0,17 |
| **Banco Santander Mexico S.A.** | | | | |
| 25,500 % fällig am 17.07.2019 | ARS | 18.200 | 416 | 0,14 |
| **Banco Santander S.A.** | | | | |
| 3,306 % fällig am 27.06.2029 | $ | 400 | 403 | 0,14 |
| 4,379 % fällig am 12.04.2028 | | 200 | 213 | 0,07 |
| **Bank of America Corp.** | | | | |
| 2,816 % fällig am 21.07.2023 | | 700 | 707 | 0,25 |
| 3,300 % fällig am 11.01.2023 | | 200 | 206 | 0,07 |
| 3,559 % fällig am 23.04.2027 | | 200 | 209 | 0,07 |
| 3,581 % fällig am 24.04.2023 | | 100 | 101 | 0,04 |
| 3,974 % fällig am 07.02.2030 | | 100 | 107 | 0,04 |
| 4,100 % fällig am 24.07.2023 | | 1.950 | 2.082 | 0,72 |
| **Barclays Bank PLC** | | | | |
| 7,625 % fällig am 21.11.2022 (f) | | 1.100 | 1.202 | 0,42 |
| **Barclays PLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 08.06.2020 | | 300 | 300 | 0,10 |
| 3,200 % fällig am 10.08.2021 | | 200 | 202 | 0,07 |
| 3,250 % fällig am 12.02.2027 | £ | 300 | 390 | 0,14 |
| 4,972 % fällig am 16.05.2029 | $ | 200 | 213 | 0,07 |
| 7,875 % fällig am 15.09.2022 (d)(f) | £ | 300 | 405 | 0,14 |
| 8,000 % fällig am 15.12.2020 (d)(f) | € | 300 | 370 | 0,13 |
| 8,000 % fällig am 15.06.2024 (d)(f) | $ | 200 | 210 | 0,07 |
| **BBVA Bancomer S.A.** | | | | |
| 6,500 % fällig am 10.03.2021 | | 400 | 421 | 0,15 |
| **Berkshire Hathaway Finance Corp.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.05.2042 | | 300 | 338 | 0,12 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 24.07.2023 | | 400 | 419 | 0,15 |
| **Blackstone Holdings Finance Co. LLC** | | | | |
| 1,500 % fällig am 10.04.2029 | € | 700 | 827 | 0,29 |
| **BNP Paribas S.A.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.03.2023 | $ | 200 | 206 | 0,07 |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 300 | 322 | 0,11 |
| 5,198 % fällig am 10.01.2030 | | 500 | 573 | 0,20 |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 10.10.2024 | | 300 | 305 | 0,11 |
| 3,626 % fällig am 02.05.2021 | | 200 | 201 | 0,07 |
| 4,000 % fällig am 25.01.2024 | | 300 | 311 | 0,11 |
| **Boston Properties LP** | | | | |
| 3,400 % fällig am 21.06.2029 | | 200 | 205 | 0,07 |
| **BPCE S.A.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 11.01.2023 | | 800 | 806 | 0,28 |
| **Brixmor Operating Partnership LP** | | | | |
| 3,629 % fällig am 01.02.2022 | | 200 | 200 | 0,07 |
| **Brookfield Finance, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2024 | | 400 | 421 | 0,15 |
| **CaixaBank S.A.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 23.03.2026 (d)(f) | € | 200 | $ 215 | 0,07 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | | |
| 4,875 % fällig am 01.05.2024 | $ | 1.100 | 1.135 | 0,39 |
| **CBL & Associates LP** | | | | |
| 5,950 % fällig am 15.12.2026 | | 600 | 414 | 0,14 |
| **China Evergrande Group** | | | | |
| 6,250 % fällig am 28.06.2021 | | 500 | 481 | 0,17 |
| 7,000 % fällig am 23.03.2020 | | 400 | 405 | 0,14 |
| **CIT Group, Inc.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.08.2022 | | 100 | 106 | 0,04 |
| **Citigroup, Inc.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 27.10.2022 | | 1.300 | 1.312 | 0,45 |
| 3,200 % fällig am 21.10.2026 | | 100 | 102 | 0,04 |
| 3,540 % fällig am 25.04.2022 | | 300 | 303 | 0,10 |
| 3,543 % fällig am 01.06.2024 | | 900 | 905 | 0,31 |
| 3,569 % fällig am 01.07.2026 | | 200 | 202 | 0,07 |
| 3,950 % fällig am 01.09.2023 | | 200 | 204 | 0,07 |
| 4,075 % fällig am 23.04.2029 | | 400 | 430 | 0,15 |
| 8,125 % fällig am 15.07.2039 | | 2.200 | 3.524 | 1,22 |
| **CME Group, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.06.2028 | | 200 | 218 | 0,08 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 5,500 % fällig am 29.06.2020 (d)(f) | € | 1.000 | 1.187 | 0,41 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | | |
| 7,500 % fällig am 09.03.2020 | $ | 500 | 510 | 0,18 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | | |
| 2,125 % fällig am 04.10.2024 | € | 600 | 701 | 0,24 |
| **Credit Suisse AG** | | | | |
| 6,500 % fällig am 08.08.2023 (f) | $ | 900 | 993 | 0,34 |
| **Credit Suisse Group AG** | | | | |
| 2,997 % fällig am 14.12.2023 | | 250 | 252 | 0,09 |
| 3,574 % fällig am 09.01.2023 | | 250 | 255 | 0,09 |
| 3,676 % fällig am 12.06.2024 | | 700 | 702 | 0,24 |
| 7,500 % fällig am 17.07.2023 (d)(f) | | 200 | 214 | 0,07 |
| **Crown Castle International Corp.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.07.2023 | | 400 | 408 | 0,14 |
| 4,300 % fällig am 15.02.2029 | | 400 | 433 | 0,15 |
| 4,450 % fällig am 15.02.2026 | | 100 | 108 | 0,04 |
| **Deutsche Bank AG** | | | | |
| 0,180 % fällig am 07.12.2020 | € | 100 | 113 | 0,04 |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | | 300 | 345 | 0,12 |
| 1,875 % fällig am 28.02.2020 | £ | 200 | 254 | 0,09 |
| 3,150 % fällig am 22.01.2021 | $ | 600 | 596 | 0,21 |
| 3,300 % fällig am 16.11.2022 | | 200 | 197 | 0,07 |
| 3,715 % fällig am 16.11.2022 | | 500 | 483 | 0,17 |
| 3,855 % fällig am 04.02.2021 | | 150 | 149 | 0,05 |
| **Discover Financial Services** | | | | |
| 4,100 % fällig am 09.02.2027 | | 300 | 313 | 0,11 |
| 4,500 % fällig am 30.01.2026 | | 100 | 107 | 0,04 |
| **E*TRADE Financial Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 20.06.2028 | | 200 | 210 | 0,07 |
| **EPR Properties** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.12.2026 | | 100 | 106 | 0,04 |
| 4,950 % fällig am 15.04.2028 | | 300 | 323 | 0,11 |
| **ERP Operating LP** | | | | |
| 3,250 % fällig am 01.08.2027 | | 100 | 104 | 0,04 |
| **Erste Group Bank AG** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.10.2025 (d)(f) | € | 200 | 241 | 0,08 |
| **Essex Portfolio LP** | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2025 | $ | 525 | 543 | 0,19 |
| **Fairfax Financial Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 29.03.2028 | € | 200 | 244 | 0,08 |
| 4,850 % fällig am 17.04.2028 | $ | 300 | 317 | 0,11 |
| **First American Financial Corp.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 01.02.2023 | | 100 | 104 | 0,04 |
| **Flagstar Bancorp, Inc.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 15.07.2021 | | 200 | 211 | 0,07 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | | |
| 3,408 % fällig am 05.04.2021 | | 900 | 888 | 0,31 |
| 3,600 % fällig am 28.03.2022 | | 200 | 197 | 0,07 |
| 3,656 % fällig am 03.08.2022 | | 600 | 587 | 0,20 |
| 3,753 % fällig am 15.02.2023 | | 300 | 291 | 0,10 |
| 5,596 % fällig am 07.01.2022 | | 400 | 424 | 0,15 |
| **Freedom Mortgage Corp.** | | | | |
| 8,125 % fällig am 15.11.2024 | | 200 | 171 | 0,06 |
| 10,750 % fällig am 01.04.2024 | | 300 | 281 | 0,10 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARK-TWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.** | | | |
| 3,400 % fällig am 30.09.2026 | $ 500 | $ 500 | 0,17 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | |
| 4,418 % fällig am 15.11.2035 | 300 | 297 | 0,10 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | |
| 3,640 % fällig am 30.06.2022 | 100 | 100 | 0,03 |
| 3,665 % fällig am 06.11.2021 | 300 | 300 | 0,10 |
| 4,147 % fällig am 14.01.2022 | 400 | 404 | 0,14 |
| 4,200 % fällig am 06.11.2021 | 700 | 721 | 0,25 |
| **GLP Capital LP** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2025 | 300 | 322 | 0,11 |
| 5,300 % fällig am 15.01.2029 | 100 | 108 | 0,04 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 3,363 % fällig am 31.10.2022 | 500 | 500 | 0,17 |
| 3,500 % fällig am 23.01.2025 | 1.650 | 1.708 | 0,59 |
| 3,581 % fällig am 24.07.2023 | 100 | 100 | 0,03 |
| 3,688 % fällig am 15.11.2021 | 900 | 908 | 0,31 |
| 4,223 % fällig am 01.05.2029 | 1.900 | 2.039 | 0,71 |
| **Great-West Lifeco Finance LP** | | | |
| 4,581 % fällig am 17.05.2048 | 300 | 338 | 0,12 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | |
| 3,460 % fällig am 02.03.2021 | 200 | 200 | 0,07 |
| **Highwoods Realty LP** | | | |
| 4,200 % fällig am 15.04.2029 | 200 | 209 | 0,07 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** | | | |
| 3,510 % fällig am 28.06.2021 | 600 | 602 | 0,21 |
| **Hospitality Properties Trust** | | | |
| 4,375 % fällig am 15.02.2030 | 2.400 | 2.293 | 0,79 |
| **Host Hotels & Resorts LP** | | | |
| 3,875 % fällig am 01.04.2024 | 100 | 103 | 0,04 |
| 4,000 % fällig am 15.06.2025 | 100 | 104 | 0,04 |
| **HSBC Capital Funding LP** | | | |
| 10,176 % fällig am 30.06.2030 (d) | 400 | 623 | 0,22 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | |
| 3,803 % fällig am 11.03.2025 | 200 | 209 | 0,07 |
| 3,950 % fällig am 18.05.2024 | 800 | 837 | 0,29 |
| 3,973 % fällig am 22.05.2030 | 1.300 | 1.359 | 0,47 |
| 4,300 % fällig am 08.03.2026 | 600 | 645 | 0,22 |
| 4,583 % fällig am 19.06.2029 | 400 | 438 | 0,15 |
| **Hudson Pacific Properties LP** | | | |
| 4,650 % fällig am 01.04.2029 | 100 | 107 | 0,04 |
| **ING Groep NV** | | | |
| 4,050 % fällig am 09.04.2029 | 700 | 747 | 0,26 |
| 4,100 % fällig am 02.10.2023 | 300 | 317 | 0,11 |
| **Intercontinental Exchange, Inc.** | | | |
| 3,750 % fällig am 21.09.2028 | 300 | 324 | 0,11 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | |
| 6,500 % fällig am 24.02.2021 | 700 | 737 | 0,26 |
| **Itau Unibanco Holding S.A.** | | | |
| 6,125 % fällig am 12.12.2022 (d)(f) | 400 | 407 | 0,14 |
| 6,500 % fällig am 19.03.2023 (d)(f) | 800 | 824 | 0,29 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | |
| 2,500 % fällig am 27.06.2022 | 100 | 100 | 0,03 |
| **Jefferies Finance LLC** | | | |
| 6,250 % fällig am 03.06.2026 | 1.300 | 1.315 | 0,46 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | |
| 3,220 % fällig am 01.03.2025 | 200 | 206 | 0,07 |
| 3,482 % fällig am 23.07.2024 | 900 | 903 | 0,31 |
| 3,509 % fällig am 23.01.2029 | 1.000 | 1.040 | 0,36 |
| 3,900 % fällig am 15.07.2025 | 900 | 962 | 0,33 |
| 3,960 % fällig am 29.01.2027 | 4.800 | 5.138 | 1,78 |
| 4,005 % fällig am 23.04.2029 | 500 | 540 | 0,19 |
| 4,203 % fällig am 23.07.2029 | 400 | 438 | 0,15 |
| **KBC Group NV** | | | |
| 4,250 % fällig am 24.10.2025 (d)(f) | € 600 | 671 | 0,23 |
| **KSA Sukuk Ltd.** | | | |
| 2,894 % fällig am 20.04.2022 | $ 300 | 304 | 0,11 |
| **Lazard Group LLC** | | | |
| 3,625 % fällig am 01.03.2027 | 100 | 101 | 0,04 |
| 3,750 % fällig am 13.02.2025 | 300 | 312 | 0,11 |
| 4,375 % fällig am 11.03.2029 | 1.000 | 1.058 | 0,37 |
| **Liberty Property LP** | | | |
| 4,375 % fällig am 01.02.2029 | 200 | 217 | 0,08 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | |
| 7,500 % fällig am 02.04.2032 | 200 | 160 | 0,06 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | |
| 4,375 % fällig am 22.03.2028 | 800 | 851 | 0,29 |
| 4,450 % fällig am 08.05.2025 | $ 1.100 | $ 1.172 | 0,41 |
| 7,875 % fällig am 27.06.2029 (d)(f) | £ 300 | 434 | 0,15 |
| **MassMutual Global Funding** | | | |
| 3,400 % fällig am 08.03.2026 | $ 500 | 524 | 0,18 |
| **Metropolitan Life Global Funding** | | | |
| 0,375 % fällig am 09.04.2024 | € 200 | 231 | 0,08 |
| **MGM Growth Properties Operating Partnership LP** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.01.2028 | $ 100 | 100 | 0,03 |
| 5,750 % fällig am 01.02.2027 | 100 | 108 | 0,04 |
| **Mid-America Apartments LP** | | | |
| 4,200 % fällig am 15.06.2028 | 400 | 430 | 0,15 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | |
| 2,190 % fällig am 13.09.2021 | 1.000 | 995 | 0,34 |
| 3,370 % fällig am 25.07.2022 | 100 | 100 | 0,03 |
| 3,446 % fällig am 26.07.2023 | 2.700 | 2.706 | 0,94 |
| 3,455 % fällig am 02.03.2023 | 100 | 103 | 0,04 |
| **Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.** | | | |
| 2,652 % fällig am 19.09.2022 | 300 | 300 | 0,10 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | |
| 3,331 % fällig am 11.09.2022 | 200 | 201 | 0,07 |
| **MUFG Bank Ltd.** | | | |
| 2,850 % fällig am 08.09.2021 | 500 | 505 | 0,18 |
| **Nationstar Mortgage Holdings, Inc.** | | | |
| 8,125 % fällig am 15.07.2023 | 300 | 307 | 0,11 |
| **Nationwide Building Society** | | | |
| 3,622 % fällig am 26.04.2023 | 800 | 815 | 0,28 |
| 4,000 % fällig am 14.09.2026 | 300 | 300 | 0,10 |
| 4,363 % fällig am 01.08.2024 | 200 | 209 | 0,07 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | 200 | 208 | 0,07 |
| **New York Life Insurance Co.** | | | |
| 4,450 % fällig am 15.05.2069 | 300 | 331 | 0,11 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | |
| 2,150 % fällig am 28.09.2020 | 1.100 | 1.094 | 0,38 |
| 3,875 % fällig am 21.09.2023 | 700 | 726 | 0,25 |
| **Omega Healthcare Investors, Inc.** | | | |
| 4,375 % fällig am 01.08.2023 | 400 | 416 | 0,14 |
| **Physicians Realty LP** | | | |
| 3,950 % fällig am 15.01.2028 | 400 | 403 | 0,14 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | |
| 3,500 % fällig am 28.03.2024 | 500 | 510 | 0,18 |
| 3,576 % fällig am 02.05.2022 | 1.000 | 1.008 | 0,35 |
| **Quicken Loans, Inc.** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2028 | 200 | 200 | 0,07 |
| **Regency Centers LP** | | | |
| 3,600 % fällig am 01.02.2027 | 200 | 207 | 0,07 |
| 4,400 % fällig am 01.02.2047 | 100 | 108 | 0,04 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | |
| 2,000 % fällig am 04.03.2025 | € 725 | 858 | 0,30 |
| 4,269 % fällig am 22.03.2025 | $ 300 | 310 | 0,11 |
| 4,892 % fällig am 18.05.2029 | 1.300 | 1.389 | 0,48 |
| **Sabra Health Care LP** | | | |
| 4,800 % fällig am 01.06.2024 | 700 | 721 | 0,25 |
| **Sagax AB** | | | |
| 2,250 % fällig am 13.03.2025 | € 300 | 356 | 0,12 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | |
| 3,400 % fällig am 18.01.2023 | $ 300 | 305 | 0,11 |
| 4,450 % fällig am 03.12.2021 | 400 | 416 | 0,14 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | |
| 3,373 % fällig am 05.01.2024 | 200 | 202 | 0,07 |
| 3,823 % fällig am 03.11.2028 | 200 | 202 | 0,07 |
| 7,375 % fällig am 24.06.2022 (d)(f) | £ 300 | 406 | 0,14 |
| **Santander UK PLC** | | | |
| 2,875 % fällig am 18.06.2024 | $ 900 | 906 | 0,31 |
| 3,400 % fällig am 01.06.2021 | 300 | 305 | 0,11 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | |
| 6,125 % fällig am 07.02.2022 | 1.100 | 1.170 | 0,41 |
| **Shriram Transport Finance Co. Ltd.** | | | |
| 5,700 % fällig am 27.02.2022 | 900 | 914 | 0,32 |
| **SL Green Operating Partnership LP** | | | |
| 3,250 % fällig am 15.10.2022 | 200 | 203 | 0,07 |
| 3,505 % fällig am 16.08.2021 | 200 | 200 | 0,07 |
| **SLM Corp.** | | | |
| 5,125 % fällig am 05.04.2022 | 100 | 100 | 0,03 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | |
| 3,550 % fällig am 15.04.2024 | 200 | 206 | 0,07 |
| **Societe Generale S.A.** | | | |
| 7,375 % fällig am 04.10.2023 (d)(f) | $ 300 | $ 312 | 0,11 |
| **Spirit Realty LP** | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2029 | 300 | 303 | 0,10 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | 300 | 323 | 0,11 |
| **Stearns Holdings LLC** | | | |
| 9,375 % fällig am 15.08.2020 | 193 | 184 | 0,06 |
| **STORE Capital Corp.** | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2028 | 200 | 211 | 0,07 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | |
| 3,102 % fällig am 17.01.2023 | 200 | 204 | 0,07 |
| 3,452 % fällig am 19.07.2023 | 100 | 100 | 0,03 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | |
| 8,375 % fällig am 15.01.2021 | 200 | 207 | 0,07 |
| 8,625 % fällig am 27.07.2020 | 200 | 206 | 0,07 |
| **Synchrony Financial** | | | |
| 4,375 % fällig am 19.03.2024 | 400 | 419 | 0,15 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | |
| 5,661 % fällig am 13.10.2041 | £ 295 | 485 | 0,17 |
| **TP ICAP PLC** | | | |
| 5,250 % fällig am 29.05.2026 | 1.300 | 1.695 | 0,59 |
| **UBS AG** | | | |
| 3,031 % fällig am 08.06.2020 | $ 600 | 603 | 0,21 |
| 7,625 % fällig am 17.08.2022 (f) | 350 | 393 | 0,14 |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | |
| 4,125 % fällig am 24.09.2025 | 300 | 320 | 0,11 |
| **UDR, Inc.** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2028 | 300 | 308 | 0,11 |
| **UniCredit SpA** | | | |
| 7,500 % fällig am 03.06.2026 (d)(f) | € 600 | 722 | 0,25 |
| 7,830 % fällig am 04.12.2023 | $ 600 | 686 | 0,24 |
| **Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.** | | | |
| 4,150 % fällig am 18.04.2023 | 400 | 411 | 0,14 |
| **Ventas Realty LP** | | | |
| 3,250 % fällig am 15.10.2026 | 400 | 404 | 0,14 |
| **VEREIT Operating Partnership LP** | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | 100 | 103 | 0,04 |
| 4,625 % fällig am 01.11.2025 | 400 | 431 | 0,15 |
| 4,875 % fällig am 01.06.2026 | 200 | 216 | 0,07 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2024 | € 100 | 117 | 0,04 |
| **Volkswagen Financial Services NV** | | | |
| 1,875 % fällig am 07.09.2021 | £ 600 | 767 | 0,27 |
| **Washington Prime Group LP** | | | |
| 5,950 % fällig am 15.08.2024 | $ 300 | 285 | 0,10 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | |
| 2,625 % fällig am 22.07.2022 | 100 | 101 | 0,04 |
| 3,196 % fällig am 17.06.2027 | 200 | 204 | 0,07 |
| 3,465 % fällig am 11.02.2022 | 100 | 101 | 0,04 |
| 3,550 % fällig am 29.09.2025 | 1.500 | 1.568 | 0,54 |
| 3,584 % fällig am 22.05.2028 | 100 | 104 | 0,04 |
| 3,691 % fällig am 24.01.2023 | 400 | 405 | 0,14 |
| 3,750 % fällig am 24.01.2024 | 200 | 210 | 0,07 |
| 3,813 % fällig am 31.10.2023 | 500 | 510 | 0,18 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | |
| 2,897 % fällig am 27.05.2022 | 1.300 | 1.313 | 0,46 |
| 3,124 % fällig am 06.12.2019 | 600 | 602 | 0,21 |
| **Weyerhaeuser Co.** | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2029 | 800 | 852 | 0,30 |
| 4,625 % fällig am 15.09.2023 | 200 | 215 | 0,07 |
| 7,375 % fällig am 15.03.2032 | 435 | 609 | 0,21 |
| **WP Carey, Inc.** | | | |
| 3,850 % fällig am 15.07.2029 | 200 | 202 | 0,07 |
| 4,250 % fällig am 01.10.2026 | 800 | 834 | 0,29 |
| | 127.580 | | 44,23 |
| **INDUSTRIEWERTE** | | | |
| **21Vianet Group, Inc.** | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2021 | 200 | 206 | 0,07 |
| **AbbVie, Inc.** | | | |
| 4,875 % fällig am 14.11.2048 | 1.300 | 1.370 | 0,48 |
| **Activision Blizzard, Inc.** | | | |
| 3,400 % fällig am 15.09.2026 | 800 | 812 | 0,28 |
| **Air Canada Pass-Through Trust** | | | |
| 3,750 % fällig am 15.06.2029 | 171 | 179 | 0,06 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARK-TWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Allergan Sales LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2021 | $ | 200 | $ 209 | 0,07 |
| **Alliance Data Systems Corp.** | | | | |
| 5,375 % fällig am 01.08.2022 | | 100 | 102 | 0,04 |
| 5,875 % fällig am 01.11.2021 | | 100 | 103 | 0,04 |
| **ALROSA Finance S.A.** | | | | |
| 4,650 % fällig am 09.04.2024 | | 400 | 415 | 0,14 |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | | |
| 7,750 % fällig am 15.05.2022 | | 200 | 204 | 0,07 |
| **Altria Group, Inc.** | | | | |
| 3,490 % fällig am 14.02.2022 | | 700 | 720 | 0,25 |
| **American Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.04.2031 | | 189 | 192 | 0,07 |
| 3,375 % fällig am 01.11.2028 | | 241 | 245 | 0,09 |
| 3,600 % fällig am 15.04.2031 | | 284 | 285 | 0,10 |
| 4,000 % fällig am 15.01.2027 | | 361 | 377 | 0,13 |
| 5,250 % fällig am 31.07.2022 | | 119 | 123 | 0,04 |
| **Amgen, Inc.** | | | | |
| 4,663 % fällig am 15.06.2051 | | 500 | 547 | 0,19 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2025 | | 200 | 212 | 0,07 |
| **Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 15.04.2048 | | 1.300 | 1.394 | 0,48 |
| 4,750 % fällig am 23.01.2029 | | 900 | 1.023 | 0,35 |
| **ANR Pipeline Co.** | | | | |
| 9,625 % fällig am 01.11.2021 | | 300 | 346 | 0,12 |
| **Anthem, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.12.2022 | | 600 | 609 | 0,21 |
| 3,650 % fällig am 01.12.2027 | | 100 | 104 | 0,04 |
| 4,101 % fällig am 01.03.2028 | | 200 | 214 | 0,07 |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | | | |
| 3,750 % fällig am 22.09.2024 | | 1.100 | 1.115 | 0,39 |
| **Apple, Inc.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 11.05.2027 | | 300 | 313 | 0,11 |
| **APT Pipelines Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.07.2027 | | 250 | 262 | 0,09 |
| **Aptiv Corp.** | | | | |
| 4,150 % fällig am 15.03.2024 | | 100 | 105 | 0,04 |
| **Aptiv PLC** | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.03.2029 | | 200 | 211 | 0,07 |
| **Arrow Electronics, Inc.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 08.09.2024 | | 300 | 297 | 0,10 |
| **AstraZeneca PLC** | | | | |
| 3,190 % fällig am 17.08.2023 | | 1.787 | 1.782 | 0,62 |
| **B.C. Unlimited Liability Co.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.05.2024 | | 100 | 101 | 0,04 |
| **Bacardi Ltd.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.05.2025 | | 500 | 532 | 0,18 |
| 4,500 % fällig am 15.01.2021 | | 1.500 | 1.535 | 0,53 |
| **Baidu, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 29.09.2023 | | 200 | 208 | 0,07 |
| 4,375 % fällig am 14.05.2024 | | 200 | 212 | 0,07 |
| 4,875 % fällig am 14.11.2028 | | 400 | 439 | 0,15 |
| **BAT Capital Corp.** | | | | |
| 1,125 % fällig am 16.11.2023 | € | 100 | 117 | 0,04 |
| 3,557 % fällig am 15.08.2027 | $ | 700 | 697 | 0,24 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | | |
| 2,979 % fällig am 25.06.2021 | | 700 | 696 | 0,24 |
| 3,420 % fällig am 15.12.2023 | | 500 | 491 | 0,17 |
| 3,500 % fällig am 25.06.2021 | | 300 | 304 | 0,11 |
| **BMC East LLC** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2024 | | 100 | 102 | 0,04 |
| **Boston Scientific Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.03.2029 | | 600 | 650 | 0,23 |
| **Braskem Finance Ltd.** | | | | |
| 6,450 % fällig am 03.02.2024 | | 200 | 222 | 0,08 |
| **Bristol-Myers Squibb Co.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.06.2026 | | 600 | 624 | 0,22 |
| **Broadcom Corp.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.01.2024 | | 500 | 505 | 0,18 |
| 3,875 % fällig am 15.01.2027 | | 1.000 | 981 | 0,34 |
| **Broadcom, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2021 | | 300 | 302 | 0,10 |
| 3,125 % fällig am 15.10.2022 | | 500 | 503 | 0,17 |
| **Builders FirstSource, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 01.09.2024 | | 100 | 103 | 0,04 |
| **Campbell Soup Co.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.03.2025 | $ | 200 | $ 208 | 0,07 |
| **Celgene Corp.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.08.2025 | | 300 | 322 | 0,11 |
| **Cenovus Energy, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 15.04.2027 | | 300 | 311 | 0,11 |
| **CenterPoint Energy Resources Corp.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.04.2023 | | 300 | 309 | 0,11 |
| **Central Japan Railway Co.** | | | | |
| 2,800 % fällig am 23.02.2022 | | 500 | 505 | 0,18 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 2,091 % fällig am 14.09.2021 | | 2.000 | 1.981 | 0,69 |
| **CH Robinson Worldwide, Inc.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.04.2028 | | 200 | 214 | 0,07 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.03.2028 | | 100 | 104 | 0,04 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | | 600 | 631 | 0,22 |
| 5,750 % fällig am 01.04.2048 | | 1.000 | 1.108 | 0,38 |
| **Cheniere Corpus Christi Holdings LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 31.03.2025 | | 200 | 223 | 0,08 |
| **Cheniere Energy Partners LP** | | | | |
| 5,250 % fällig am 01.10.2025 | | 600 | 622 | 0,22 |
| **Cimarex Energy Co.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2029 | | 500 | 532 | 0,18 |
| **Comcast Corp.** | | | | |
| 2,350 % fällig am 15.01.2027 | | 100 | 98 | 0,03 |
| 3,900 % fällig am 01.03.2038 | | 100 | 105 | 0,04 |
| 3,999 % fällig am 01.11.2049 | | 100 | 106 | 0,04 |
| 4,600 % fällig am 15.08.2045 | | 300 | 341 | 0,12 |
| **Community Health Systems, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 01.08.2021 | | 100 | 98 | 0,03 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2024 | | 300 | 301 | 0,10 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 22.10.2021 | | 1.300 | 1.337 | 0,46 |
| 4,600 % fällig am 01.11.2025 | | 600 | 654 | 0,23 |
| **Concho Resources, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 01.10.2027 | | 100 | 104 | 0,04 |
| 4,300 % fällig am 15.08.2028 | | 200 | 216 | 0,08 |
| **Constellation Oil Services Holding S.A.** | | | | |
| 9,500 % fällig am 09.11.2024 ^(b) | | 151 | 72 | 0,03 |
| **Continental Resources, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 01.06.2024 | | 200 | 206 | 0,07 |
| **CRH America Finance, Inc.** | | | | |
| 3,400 % fällig am 09.05.2027 | | 200 | 200 | 0,07 |
| **Crown Castle Towers LLC** | | | | |
| 3,720 % fällig am 15.07.2043 | | 100 | 103 | 0,04 |
| **CVS Health Corp.** | | | | |
| 4,300 % fällig am 25.03.2028 | | 1.000 | 1.055 | 0,37 |
| **CVS Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,789 % fällig am 10.01.2026 | | 85 | 91 | 0,03 |
| 6,036 % fällig am 10.12.2028 | | 59 | 66 | 0,02 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.08.2023 | | 100 | 110 | 0,04 |
| **DAE Funding LLC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 01.08.2024 | | 100 | 104 | 0,04 |
| 5,750 % fällig am 15.11.2023 | | 400 | 421 | 0,15 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | | |
| 2,875 % fällig am 10.03.2021 | | 1.000 | 1.005 | 0,35 |
| **Danone S.A.** | | | | |
| 2,589 % fällig am 02.11.2023 | | 1.200 | 1.207 | 0,42 |
| **Dell International LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.07.2024 | | 600 | 616 | 0,21 |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 1.300 | 1.340 | 0,46 |
| 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 300 | 324 | 0,11 |
| 6,020 % fällig am 15.06.2026 | | 500 | 552 | 0,19 |
| **Discovery Communications LLC** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.05.2029 | | 400 | 417 | 0,14 |
| **DISH DBS Corp.** | | | | |
| 6,750 % fällig am 01.06.2021 | | 200 | 210 | 0,07 |
| **eBay, Inc.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 05.06.2027 | | 100 | 102 | 0,04 |
| **Embraer Netherlands Finance BV** | | | | |
| 5,050 % fällig am 15.06.2025 | | 100 | 108 | 0,04 |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.12.2026 | | 300 | 326 | 0,11 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | | |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | $ | 150 | $ 153 | 0,05 |
| 4,200 % fällig am 15.04.2027 | | 300 | 312 | 0,11 |
| 4,250 % fällig am 15.03.2023 | | 400 | 418 | 0,15 |
| 5,250 % fällig am 15.04.2029 | | 200 | 224 | 0,08 |
| 5,950 % fällig am 01.10.2043 | | 100 | 110 | 0,04 |
| 7,500 % fällig am 15.10.2020 | | 1.300 | 1.379 | 0,48 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | | |
| 5,875 % fällig am 01.03.2022 | | 250 | 268 | 0,09 |
| **Enterprise Products Operating LLC** | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.03.2023 | | 200 | 206 | 0,07 |
| **EQM Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2024 | | 200 | 199 | 0,07 |
| 5,500 % fällig am 15.07.2028 | | 300 | 316 | 0,11 |
| **EQT Corp.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 01.10.2022 | | 100 | 99 | 0,03 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | | |
| 2,600 % fällig am 01.12.2021 | | 383 | 384 | 0,13 |
| 2,700 % fällig am 01.11.2023 | | 900 | 902 | 0,31 |
| **Fox Corp.** | | | | |
| 5,576 % fällig am 25.01.2049 | | 900 | 1.103 | 0,38 |
| **GATX Corp.** | | | | |
| 4,700 % fällig am 01.04.2029 | | 600 | 662 | 0,23 |
| **General Electric Co.** | | | | |
| 0,375 % fällig am 17.05.2022 | € | 200 | 229 | 0,08 |
| 4,650 % fällig am 17.10.2021 | $ | 500 | 521 | 0,18 |
| 5,550 % fällig am 05.01.2026 | | 300 | 335 | 0,12 |
| 5,875 % fällig am 14.01.2038 | | 100 | 113 | 0,04 |
| **Gerdau Trade, Inc.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 24.10.2027 | | 200 | 209 | 0,07 |
| **Greene King Finance PLC** | | | | |
| 5,318 % fällig am 15.09.2031 | £ | 136 | 201 | 0,07 |
| **Gulfport Energy Corp.** | | | | |
| 6,000 % fällig am 15.10.2024 | $ | 200 | 155 | 0,05 |
| **Halliburton Co.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 15.11.2025 | | 200 | 210 | 0,07 |
| **HCA, Inc.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.03.2022 | | 1.200 | 1.312 | 0,45 |
| 5,875 % fällig am 01.02.2029 | | 200 | 219 | 0,08 |
| **Huntsman International LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.05.2029 | | 200 | 207 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 15.11.2022 | | 500 | 529 | 0,18 |
| **Hyundai Capital America** | | | | |
| 3,202 % fällig am 18.09.2020 | | 300 | 300 | 0,10 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,625 % PIK)** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.05.2027 (b) | € | 300 | 348 | 0,12 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % bar und 7,125 % PIK)** | | | | |
| 6,375 % fällig am 15.05.2029 (b) | $ | 100 | 100 | 0,03 |
| **IHS Markit Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 01.05.2024 | | 300 | 310 | 0,11 |
| 4,250 % fällig am 01.05.2029 | | 600 | 631 | 0,22 |
| 4,750 % fällig am 01.08.2028 | | 200 | 219 | 0,08 |
| **Incitec Pivot Finance LLC** | | | | |
| 3,950 % fällig am 03.08.2027 | | 500 | 489 | 0,17 |
| 6,000 % fällig am 10.12.2019 | | 600 | 608 | 0,21 |
| **JB Hunt Transport Services, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.03.2026 | | 1.100 | 1.153 | 0,40 |
| **JT International Financial Services BV** | | | | |
| 3,500 % fällig am 28.09.2023 | | 1.100 | 1.144 | 0,40 |
| **Kansas City Southern** | | | | |
| 3,000 % fällig am 15.05.2023 | | 100 | 102 | 0,04 |
| 3,125 % fällig am 01.06.2026 | | 300 | 294 | 0,10 |
| **Keurig Dr Pepper, Inc.** | | | | |
| 5,085 % fällig am 25.05.2048 | | 500 | 558 | 0,19 |
| **KLA-Tencor Corp.** | | | | |
| 4,100 % fällig am 15.03.2029 | | 400 | 421 | 0,15 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | | |
| 2,437 % fällig am 11.09.2022 | | 200 | 200 | 0,07 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 700 | 717 | 0,25 |
| 4,875 % fällig am 15.02.2025 | | 600 | 619 | 0,21 |
| **Latam Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 4,200 % fällig am 15.08.2029 | | 81 | 82 | 0,03 |
| **Marathon Oil Corp.** | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.07.2027 | | 100 | 106 | 0,04 |
| **Marvell Technology Group Ltd.** | | | | |
| 4,200 % fällig am 22.06.2023 | | 200 | 208 | 0,07 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Masco Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.05.2047 | $ | 100 | $ 95 | 0,03 |
| **Melco Resorts Finance Ltd.** | | | | |
| 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 900 | 896 | 0,31 |
| 5,250 % fällig am 26.04.2026 | | 300 | 301 | 0,10 |
| **MGM Resorts International** | | | | |
| 5,750 % fällig am 15.06.2025 | | 200 | 219 | 0,08 |
| **Microchip Technology, Inc.** | | | | |
| 3,922 % fällig am 01.06.2021 | | 1.200 | 1.222 | 0,42 |
| **Micron Technology, Inc.** | | | | |
| 4,640 % fällig am 06.02.2024 | | 900 | 939 | 0,33 |
| **Mitchells & Butlers Finance PLC** | | | | |
| 6,013 % fällig am 15.12.2030 | £ | 515 | 745 | 0,26 |
| **Moody's Corp.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 01.09.2022 | $ | 200 | 212 | 0,07 |
| **Mylan NV** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.06.2021 | | 1.800 | 1.801 | 0,62 |
| **Mylan, Inc.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 15.01.2023 | | 300 | 292 | 0,10 |
| **Netflix, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | € | 200 | 247 | 0,09 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 1,900 % fällig am 21.07.2021 | $ | 1.529 | 1.516 | 0,53 |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,625 % fällig am 15.06.2022 | | 350 | 367 | 0,13 |
| 4,625 % fällig am 01.06.2023 | | 1.400 | 1.479 | 0,51 |
| 4,875 % fällig am 01.03.2024 | | 100 | 107 | 0,04 |
| **ONEOK Partners LP** | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.09.2023 | | 200 | 216 | 0,08 |
| **Oracle Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.11.2047 | | 300 | 323 | 0,11 |
| **Owens Corning** | | | | |
| 4,200 % fällig am 01.12.2024 | | 200 | 208 | 0,07 |
| 4,400 % fällig am 30.01.2048 | | 200 | 170 | 0,06 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 22.03.2028 | | 1.100 | 1.124 | 0,39 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 200 | 207 | 0,07 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 800 | 847 | 0,29 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | | |
| 3,375 % fällig am 01.02.2022 | | 1.000 | 1.020 | 0,35 |
| 3,900 % fällig am 01.02.2024 | | 100 | 105 | 0,04 |
| 4,450 % fällig am 29.01.2026 | | 100 | 107 | 0,04 |
| **Pernod Ricard S.A.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.01.2022 | | 600 | 628 | 0,22 |
| **Petroleos Mexicanos** | | | | |
| 5,350 % fällig am 12.02.2028 | | 500 | 456 | 0,16 |
| 6,500 % fällig am 13.03.2027 | | 310 | 307 | 0,11 |
| **Pioneer Natural Resources Co.** | | | | |
| 4,450 % fällig am 15.01.2026 | | 450 | 488 | 0,17 |
| **Pitney Bowes, Inc.** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.10.2021 | | 25 | 25 | 0,01 |
| **QVC, Inc.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 15.03.2023 | | 1.000 | 1.016 | 0,35 |
| 5,125 % fällig am 02.07.2022 | | 300 | 312 | 0,11 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | |
| 2,375 % fällig am 24.06.2022 | | 200 | 200 | 0,07 |
| 2,750 % fällig am 26.06.2024 | | 200 | 202 | 0,07 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.06.2022 | | 200 | 208 | 0,07 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | | |
| 4,950 % fällig am 15.07.2029 | | 900 | 934 | 0,32 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2023 | | 800 | 872 | 0,30 |
| 5,750 % fällig am 15.05.2024 | | 200 | 223 | 0,08 |
| 6,250 % fällig am 15.03.2022 | | 100 | 109 | 0,04 |
| **Sands China Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 08.08.2023 | | 200 | 211 | 0,07 |
| 5,125 % fällig am 08.08.2025 | | 600 | 645 | 0,22 |
| **Shire Acquisitions Investments Ireland DAC** | | | | |
| 2,400 % fällig am 23.09.2021 | | 480 | 480 | 0,17 |
| 2,875 % fällig am 23.09.2023 | | 200 | 202 | 0,07 |
| **Silversea Cruise Finance Ltd.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.02.2025 | | 100 | 108 | 0,04 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 15.06.2028 | | 1.600 | 1.680 | 0,58 |
| **Sprint Spectrum Co. LLC** | | | | |
| 4,738 % fällig am 20.09.2029 | $ | 400 | $ 416 | 0,14 |
| **Standard Industries, Inc.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.01.2028 | | 500 | 497 | 0,17 |
| 5,000 % fällig am 15.02.2027 | | 200 | 203 | 0,07 |
| **Stryker Corp.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 07.03.2028 | | 200 | 212 | 0,07 |
| **Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 28.04.2026 | | 500 | 513 | 0,18 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 4,892 % fällig am 24.04.2025 | | 200 | 209 | 0,07 |
| 5,182 % fällig am 24.04.2028 | | 200 | 208 | 0,07 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | | |
| 4,103 % fällig am 08.03.2027 | | 300 | 319 | 0,11 |
| 4,665 % fällig am 06.03.2038 | | 300 | 312 | 0,11 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 400 | 409 | 0,14 |
| 3,975 % fällig am 11.04.2029 | | 500 | 523 | 0,18 |
| **Teva Pharmaceutical Finance BV** | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | | 300 | 291 | 0,10 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 2,200 % fällig am 21.07.2021 | | 500 | 476 | 0,17 |
| 6,000 % fällig am 15.04.2024 | | 200 | 189 | 0,07 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | | |
| 4,500 % fällig am 15.09.2042 | | 300 | 281 | 0,10 |
| **Toyota Tsusho Corp.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 13.09.2023 | | 1.100 | 1.145 | 0,40 |
| **Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 15.03.2028 | | 300 | 313 | 0,11 |
| **Transocean Guardian Ltd.** | | | | |
| 5,875 % fällig am 15.01.2024 | | 95 | 97 | 0,03 |
| **Transocean Pontus Ltd.** | | | | |
| 6,125 % fällig am 01.08.2025 | | 95 | 98 | 0,03 |
| **Transocean, Inc.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 01.11.2025 | | 100 | 95 | 0,03 |
| **Tyson Foods, Inc.** | | | | |
| 5,100 % fällig am 28.09.2048 | | 400 | 452 | 0,16 |
| **United Airlines Pass-Through Trust** | | | | |
| 3,750 % fällig am 03.03.2028 | | 801 | 834 | 0,29 |
| **UnitedHealth Group, Inc.** | | | | |
| 3,850 % fällig am 15.06.2028 | | 300 | 325 | 0,11 |
| **Unitymedia Hessen GmbH & Co. KG** | | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2027 | € | 100 | 121 | 0,04 |
| **Univision Communications, Inc.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.02.2025 | $ | 100 | 96 | 0,03 |
| **Vale Overseas Ltd.** | | | | |
| 4,375 % fällig am 11.01.2022 | | 26 | 27 | 0,01 |
| 6,250 % fällig am 10.08.2026 | | 300 | 342 | 0,12 |
| **Valero Energy Corp.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 01.04.2029 | | 300 | 314 | 0,11 |
| **Verisk Analytics, Inc.** | | | | |
| 4,125 % fällig am 15.03.2029 | | 200 | 215 | 0,07 |
| **ViaSat, Inc.** | | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2027 | | 300 | 313 | 0,11 |
| **Virgin Australia Pass-Through Trust** | | | | |
| 5,000 % fällig am 23.04.2025 | | 86 | 89 | 0,03 |
| **Viterra, Inc.** | | | | |
| 5,950 % fällig am 01.08.2020 | | 500 | 517 | 0,18 |
| **VMware, Inc.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | | 200 | 202 | 0,07 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.11.2021 | | 900 | 929 | 0,32 |
| **Wabtec Corp.** | | | | |
| 3,450 % fällig am 15.11.2026 | | 100 | 98 | 0,03 |
| 4,400 % fällig am 15.03.2024 | | 100 | 106 | 0,04 |
| **Waste Management, Inc.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.06.2026 | | 900 | 937 | 0,32 |
| **Western Digital Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 15.02.2026 | | 100 | 98 | 0,03 |
| **Whirlpool Corp.** | | | | |
| 4,750 % fällig am 26.02.2029 | | 100 | 108 | 0,04 |
| **Wind Tre SpA** | | | | |
| 2,750 % fällig am 20.01.2024 | € | 100 | 113 | 0,04 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 3,650 % fällig am 05.03.2025 | $ | 200 | 205 | 0,07 |
| 4,500 % fällig am 04.03.2029 | $ | 400 | $ 423 | 0,15 |
| 4,600 % fällig am 10.05.2021 | | 100 | 103 | 0,04 |
| **WPX Energy, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.09.2024 | | 100 | 103 | 0,04 |
| **WRKCo, Inc.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.06.2028 | | 400 | 412 | 0,14 |
| **Wyndham Destinations, Inc.** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.04.2027 | | 300 | 314 | 0,11 |
| **Wynn Macau Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 01.10.2027 | | 900 | 877 | 0,30 |
| **Yara International ASA** | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.06.2028 | | 200 | 216 | 0,07 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | | |
| 3,550 % fällig am 01.04.2025 | | 100 | 103 | 0,04 |
| 3,700 % fällig am 19.03.2023 | | 200 | 207 | 0,07 |
| **Zoetis, Inc.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.09.2027 | | 100 | 100 | 0,03 |
| | | | 102.225 | 35,44 |
| **VERSORGUNGSUNTERNEHMEN** | | | | |
| **American Transmission Systems, Inc.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 15.01.2022 | | 1.300 | 1.386 | 0,48 |
| **Antero Midstream Partners LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.03.2027 | | 100 | 100 | 0,03 |
| **AT&T, Inc.** | | | | |
| 3,950 % fällig am 15.01.2025 | | 250 | 264 | 0,09 |
| 4,100 % fällig am 15.02.2028 | | 966 | 1.023 | 0,35 |
| 4,350 % fällig am 01.03.2029 | | 1.000 | 1.078 | 0,37 |
| 4,500 % fällig am 09.03.2048 | | 100 | 102 | 0,04 |
| 4,550 % fällig am 09.03.2049 | | 1.254 | 1.282 | 0,44 |
| 5,150 % fällig am 15.11.2046 | | 200 | 222 | 0,08 |
| **Avangrid, Inc.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 01.06.2029 | | 1.500 | 1.571 | 0,54 |
| **Black Hills Corp.** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.01.2027 | | 400 | 398 | 0,14 |
| 4,250 % fällig am 30.11.2023 | | 600 | 636 | 0,22 |
| **CenterPoint Energy, Inc.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 01.11.2028 | | 300 | 324 | 0,11 |
| **Centrais Eletricas Brasileiras S.A.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 30.07.2019 | | 200 | 201 | 0,07 |
| **Cleco Corporate Holdings LLC** | | | | |
| 4,973 % fällig am 01.05.2046 | | 700 | 750 | 0,26 |
| **CNOOC Finance Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 09.05.2023 | | 1.000 | 1.010 | 0,35 |
| **Duke Energy Florida LLC** | | | | |
| 3,200 % fällig am 15.01.2027 | | 100 | 103 | 0,04 |
| **Enable Midstream Partners LP** | | | | |
| 4,400 % fällig am 15.03.2027 | | 300 | 303 | 0,10 |
| 4,950 % fällig am 15.05.2028 | | 700 | 734 | 0,25 |
| **Endeavor Energy Resources LP** | | | | |
| 5,750 % fällig am 30.01.2028 | | 100 | 106 | 0,04 |
| **Enel Finance International NV** | | | | |
| 2,875 % fällig am 25.05.2022 | | 200 | 202 | 0,07 |
| 3,625 % fällig am 25.05.2027 | | 200 | 201 | 0,07 |
| 4,625 % fällig am 14.09.2025 | | 1.000 | 1.074 | 0,37 |
| **Entergy Corp.** | | | | |
| 2,950 % fällig am 01.09.2026 | | 400 | 401 | 0,14 |
| 4,000 % fällig am 15.07.2022 | | 1.300 | 1.353 | 0,47 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | | |
| 3,900 % fällig am 15.07.2027 | | 200 | 210 | 0,07 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 2,949 % fällig am 24.01.2024 | € | 300 | 367 | 0,13 |
| 4,950 % fällig am 19.07.2022 | $ | 200 | 210 | 0,07 |
| 4,950 % fällig am 23.03.2027 | | 200 | 212 | 0,07 |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 1.600 | 1.708 | 0,59 |
| 6,510 % fällig am 07.03.2022 | | 100 | 108 | 0,04 |
| **Interstate Power & Light Co.** | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.04.2029 | | 1.400 | 1.458 | 0,51 |
| **IPALCO Enterprises, Inc.** | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.09.2024 | | 200 | 207 | 0,07 |
| **Midwest Connector Capital Co. LLC** | | | | |
| 3,900 % fällig am 01.04.2024 | | 300 | 312 | 0,11 |
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | | |
| 5,650 % fällig am 01.05.2079 | | 400 | 413 | 0,14 |
| **NRG Energy, Inc.** | | | | |
| 3,750 % fällig am 15.06.2024 | | 500 | 514 | 0,18 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Odebrecht Drilling Norbe Ltd.** | | | | | |
| 6,350 % fällig am 01.12.2021 | $ | 52 | $ | 52 | 0,02 |
| **ONEOK, Inc.** | | | | | |
| 4,350 % fällig am 15.03.2029 | | 400 | | 428 | 0,15 |
| 4,550 % fällig am 15.07.2028 | | 900 | | 978 | 0,34 |
| **Parsley Energy LLC** | | | | | |
| 5,375 % fällig am 15.01.2025 | | 200 | | 206 | 0,07 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | | | |
| 5,750 % fällig am 01.02.2029 | | 200 | | 209 | 0,07 |
| 7,375 % fällig am 17.01.2027 | | 300 | | 344 | 0,12 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | | | |
| 3,600 % fällig am 01.11.2024 | | 550 | | 558 | 0,19 |
| 3,650 % fällig am 01.06.2022 | | 100 | | 103 | 0,04 |
| 4,700 % fällig am 15.06.2044 | | 100 | | 97 | 0,03 |
| **Rio Oil Finance Trust** | | | | | |
| 9,250 % fällig am 06.07.2024 | | 154 | | 172 | 0,06 |
| **Rosneft Finance S.A.** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 02.02.2020 | | 900 | | 923 | 0,32 |
| **San Diego Gas & Electric Co.** | | | | | |
| 4,100 % fällig am 15.06.2049 | | 1.100 | | 1.145 | 0,40 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | | |
| 4,125 % fällig am 12.09.2025 | | 500 | | 534 | 0,19 |
| **Southern California Edison Co.** | | | | | |
| 3,700 % fällig am 01.08.2025 | | 400 | | 414 | 0,14 |
| 3,900 % fällig am 01.12.2041 | | 108 | | 102 | 0,04 |
| **Southern Co. Gas Capital Corp.** | | | | | |
| 3,250 % fällig am 15.06.2026 | | 2.300 | | 2.321 | 0,80 |
| **Sprint Corp.** | | | | | |
| 7,250 % fällig am 15.09.2021 | | 300 | | 320 | 0,11 |
| **Tallgrass Energy Partners LP** | | | | | |
| 4,750 % fällig am 01.10.2023 | | 100 | | 102 | 0,04 |
| **Tampa Electric Co.** | | | | | |
| 2,600 % fällig am 15.09.2022 | | 800 | | 803 | 0,28 |
| 4,300 % fällig am 15.06.2048 | | 400 | | 429 | 0,15 |
| **Transcanada Trust** | | | | | |
| 5,300 % fällig am 15.03.2077 | | 150 | | 144 | 0,05 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | | | |
| 3,618 % fällig am 15.05.2025 | | 300 | | 304 | 0,11 |
| 3,850 % fällig am 01.11.2042 | | 750 | | 768 | 0,27 |
| 4,329 % fällig am 21.09.2028 | $ | 1.100 | $ | 1.220 | 0,42 |
| 4,672 % fällig am 15.03.2055 | | 195 | | 221 | 0,08 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Vodafone Group PLC** | | | |
| 4,375 % fällig am 30.05.2028 | 100 | 108 | 0,04 |
| 7,000 % fällig am 04.04.2079 | 200 | 216 | 0,07 |
| | | 33.764 | 11,70 |
| Summe Unternehmensanleihen und Wechsel | | 263.569 | 91,37 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.08.2049 | 21.900 | 22.388 | 7,76 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2049 | 4.300 | 4.443 | 1,54 |
| | | 26.831 | 9,30 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.05.2046 (g)(h) | 2.647 | 2.632 | 0,91 |
| 2,750 % fällig am 15.11.2042 (h) | 1.450 | 1.521 | 0,53 |
| 2,875 % fällig am 15.05.2049 (g) | 6.305 | 6.765 | 2,34 |
| 3,000 % fällig am 15.02.2049 (g) | 6.107 | 6.708 | 2,33 |
| 3,125 % fällig am 15.05.2048 (h) | 2.891 | 3.245 | 1,12 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (c)** | | | |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 (h) | 1.058 | 1.066 | 0,37 |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 | 300 | 305 | 0,11 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,000 % fällig am 31.05.2024 | 3.860 | 3.906 | 1,35 |
| 2,375 % fällig am 15.05.2029 (g) | 14.238 | 14.715 | 5,10 |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 (g) | 10.337 | 10.902 | 3,78 |
| 2,875 % fällig am 15.08.2028 (g) | 7.450 | 8.007 | 2,78 |
| | | 59.772 | 20,72 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **Countrywide Alternative Loan Trust** | | | |
| 3,854 % fällig am 25.08.2035 ^ | 62 | 57 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust** | | | | |
| 2,860 % fällig am 25.11.2034 | | 388 | 357 | 0,12 |
| | | | 414 | 0,14 |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **New Century Home Equity Loan Trust** | | | | |
| 2,874 % fällig am 25.02.2036 | $ | 182 | $ 159 | 0,05 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 3,750 % fällig am 31.12.2038 | | 900 | 529 | 0,18 |
| 63,705 % fällig am 21.06.2020 (a) | ARS | 3.520 | 81 | 0,03 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 1.000 | 332 | 0,12 |
| 6,150 % fällig am 12.08.2032 | | 1.000 | 334 | 0,12 |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | | 1.000 | 357 | 0,12 |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | | 2.600 | 984 | 0,34 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 3,875 % fällig am 23.04.2023 | $ | 500 | 525 | 0,18 |
| **Saudi Government International Bond** | | | | |
| 3,625 % fällig am 04.03.2028 | | 300 | 309 | 0,11 |
| | | | 3.451 | 1,20 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | | |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (i)** | | | | |
| | | | 705 | 0,25 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 705 | 0,25 |
| **AKTIEN** | | | | |
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)** | | 59 | 590 | 0,20 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | | **$ 360.987** | **125,14** |

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)**

- **Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Australia Government 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 15 | $ (18) | (0,01) |
| Euro-Bund 10-Year Bond September Futures | Short | 09/2019 | 7 | (14) | 0,00 |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 14 | (25) | (0,01) |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 39 | (14) | 0,00 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Short | 09/2019 | 13 | (19) | (0,01) |
| U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September Futures | Long | 09/2019 | 23 | 148 | 0,05 |
| | | | | $ 58 | 0,02 |

**OPTIONSKAUF**

**OPTIONEN AUF BÖRSENGEHANDELTE TERMINKONTRAKTE**

| Beschreibung | Ausübungskurs | Verfallsdatum | Anzahl der Kontrakte | Kosten | Marktwert | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Put - U.S. Treasury Ultra Long-Term Bond September 2019 Futures | $ 103,000 | 23.08.2019 | 10 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 106,500 | 23.08.2019 | 49 | 1 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 5-Year Note September 2019 Futures | 106,750 | 23.08.2019 | 12 | 0 | 0 | 0,00 |
| Put - CBOT U.S. Treasury 10-Year Note September 2019 Futures | 110,000 | 23.08.2019 | 13 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | $ 1 | $ 0 | 0,00 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | | **$ 58** | **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-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| Anadarko Petroleum Corp. | 1,000 % | 20.06.2022 | $ 500 | $ 20 | 0,01 |
| AT&T, Inc. | 1,000 | 20.06.2024 | 1.100 | 0 | 0,00 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 1.700 | 7 | 0,00 |
| Canadian Natural Resources Ltd. | 1,000 | 20.06.2022 | 100 | 3 | 0,00 |
| Daimler AG | 1,000 | 20.12.2020 | € 100 | 0 | 0,00 |
| DISH DBS Corp. | 5,000 | 20.06.2023 | $ 200 | 8 | 0,00 |
| Ford Motor Credit Co. LLC | 5,000 | 20.06.2023 | 300 | (12) | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2023 | 400 | 3 | 0,00 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.12.2023 | 500 | 19 | 0,01 |
| General Electric Co. | 1,000 | 20.06.2024 | 400 | 2 | 0,00 |
| Goldman Sachs Group, Inc. | 1,000 | 20.12.2021 | 400 | 1 | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.06.2022 | 200 | 3 | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2022 | 300 | 1 | 0,00 |
| MetLife, Inc. | 1,000 | 20.12.2023 | 200 | 6 | 0,00 |
| Rolls-Royce PLC | 1,000 | 20.06.2024 | € 500 | 3 | 0,00 |
| Sherwin-Williams Co. | 1,000 | 20.12.2022 | $ 300 | 1 | 0,00 |
| Simon Property Group LP | 1,000 | 20.06.2022 | 100 | 2 | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2023 | € 100 | 2 | 0,00 |
| Vodafone Group PLC | 1,000 | 20.06.2024 | 200 | 2 | 0,00 |
| | | | | $ 71 | 0,02 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[2]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| iTraxx Europe Main 28 5-Year Index | (1,000) % | 20.12.2022 | € 3.500 | $ 8 | 0,00 |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag[3] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.EM-31 5-Year Index | 1,000 % | 20.06.2024 | $ 2.300 | $ 20 | 0,01 |
| CDX.IG-32 5-Year Index | 1,000 | 20.06.2024 | 41.600 | 143 | 0,05 |
| | | | | $ 163 | 0,06 |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeitsdatum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,880 % | 02.07.2019 | $ 1.000 | $ (4) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,940 | 02.07.2019 | 1.100 | (8) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 27.06.2024 | 1.000 | (9) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 1,980 | 28.06.2024 | 1.100 | (10) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,050 | 19.06.2024 | 1.000 | (12) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,060 | 21.06.2024 | 1.000 | (13) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,080 | 20.06.2024 | 1.000 | (14) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,080 | 26.06.2024 | 1.000 | (14) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,090 | 24.06.2024 | 1.000 | (14) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,100 | 18.06.2024 | 1.000 | (15) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,110 | 25.06.2024 | 1.000 | (15) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,160 | 12.06.2024 | 1.100 | (19) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,190 | 11.06.2024 | 900 | (17) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,200 | 05.06.2024 | 900 | (17) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,210 | 04.06.2024 | 900 | (18) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,210 | 12.06.2024 | 900 | (18) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,220 | 30.05.2024 | 900 | (18) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,240 | 29.05.2024 | 1.000 | (21) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,250 | 30.05.2024 | 900 | (20) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,270 | 06.06.2024 | 1.000 | (23) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 15.05.2024 | 900 | (21) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 28.05.2024 | 1.100 | (26) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,290 | 05.06.2024 | 900 | (22) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 17.05.2024 | 900 | (22) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,300 | 22.05.2024 | 1.100 | (27) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,310 | 24.05.2024 | 1.100 | (27) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,320 | 21.05.2024 | 1.100 | (28) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,330 | 20.05.2024 | 1.100 | (28) | (0,01) |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,410 | 11.04.2024 | 200 | (6) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 2,500 | 20.06.2048 | 700 | (97) | (0,03) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,500 | 18.12.2029 | € 1.600 | (18) | (0,01) |
| Erhalt[4] | 6-Month EUR-EURIBOR | 0,750 | 18.09.2029 | 1.300 | (71) | (0,02) |

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 % | 18.09.2029 | £ 3.300 | $ (156) | (0,05) |
| Erhalt[4] | 6-Month GBP-LIBOR | 1,500 | 18.09.2049 | 300 | (31) | (0,01) |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,000 | 19.09.2023 | HUF 115.000 | 7 | 0,00 |
| Zahlung | 6-Month HUF-BBR | 1,250 | 19.09.2023 | 352.100 | 20 | 0,01 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,300 | 20.03.2028 | ¥ 239.600 | (68) | (0,02) |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,415 | 25.03.2029 | 10.000 | (4) | 0,00 |
| Erhalt | 6-Month JPY-LIBOR | 0,450 | 20.03.2029 | 130.000 | (50) | (0,01) |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,850 | 17.04.2024 | MXN 50.500 | 60 | 0,02 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,910 | 18.04.2024 | 27.300 | 36 | 0,01 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 7,930 | 19.04.2024 | 800 | 1 | 0,00 |
| Zahlung | 28-Day MXN-TIIE | 8,038 | 29.02.2024 | 8.600 | 14 | 0,01 |
| | | | | | $ (863) | (0,30) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (621)** | **(0,22)** |

(1) Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(3) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(4) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

**DERIVATIVE OTC-FINANZINSTRUMENTE (Beträge in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)**

- **Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

**OPTIONSKAUF**

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Nenn-betrag[1] | Kosten | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,107 % | 12.09.2019 | 7.700 | $ 37 | $ 210 | 0,07 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,940 | 18.02.2020 | 3.150 | 23 | 81 | 0,03 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,258 | 18.09.2019 | 400 | 12 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,945 | 09.12.2019 | 400 | 19 | 1 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,945 | 11.12.2019 | 200 | 9 | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,258 | 18.09.2019 | 300 | 9 | 0 | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,050 | 10.09.2019 | 7.700 | 36 | 202 | 0,07 |
| | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,120 | 13.09.2019 | 7.700 | 36 | 212 | 0,08 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,258 | 18.09.2019 | 200 | 6 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,930 | 09.12.2019 | 600 | 28 | 1 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 2,943 | 12.12.2019 | 200 | 10 | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,630 | 16.12.2019 | 200 | 11 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ 236 | $ 707 | 0,25 |

**VERKAUFSOPTIONEN**

**CREDIT DEFAULT SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES**

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 % | 17.07.2019 | 700 | $ (1) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 800 | (1) | 0 | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 | 21.08.2019 | 1.000 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 700 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.800 | (2) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 800 | (1) | 0 | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 700 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 1.200 | (2) | (1) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,850 | 21.08.2019 | 1.900 | (1) | (1) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 700 | (1) | 0 | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 700 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 300 | 1 | 0 | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-31 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,800 | 17.07.2019 | 1.000 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 600 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 900 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 2,900 | 17.06.2020 | 1.200 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC iTraxx Europe 30 5-Year Index | Verkauf | 2,400 | 18.09.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs- kurs | Verfalls- datum | Nenn- betrag[1] | Aufgeld | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 3,000 % | 17.06.2020 | 1.400 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| JLN | Put - OTC iTraxx Europe 31 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 400 | (1) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ (22) | $ (4) | 0,00 |

**ZINSSWAPOPTIONEN**

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs- kurs | Verfallsdatum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,940 % | 18.09.2019 | 1.700 | $ (12) | $ 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 09.12.2019 | 1.800 | (20) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 11.12.2019 | 900 | (10) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,100 | 12.09.2019 | 1.700 | (36) | (176) | (0,06) |
| | Call - OTC 30-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,086 | 18.02.2020 | 300 | (23) | (57) | (0,02) |
| DUB | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,940 | 18.09.2019 | 1.300 | (9) | 0 | 0,00 |
| GLM | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,790 | 11.07.2019 | 1.000 | (2) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,070 | 11.07.2019 | 1.000 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,940 | 18.09.2019 | 900 | (6) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 09.12.2019 | 2.600 | (27) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,750 | 12.12.2019 | 900 | (10) | 0 | 0,00 |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 3,750 | 16.12.2019 | 1.100 | (14) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,990 | 12.07.2019 | 500 | (1) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,230 | 12.07.2019 | 500 | (1) | 0 | 0,00 |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,055 | 10.09.2019 | 1.700 | (36) | (169) | (0,06) |
| | Call - OTC 10-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 3,100 | 13.09.2019 | 1.700 | (36) | (176) | (0,06) |
| MYC | Call - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,880 | 01.07.2019 | 1.100 | (2) | (7) | (0,01) |
| | Put - OTC 5-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 2,160 | 01.07.2019 | 1.100 | (2) | 0 | 0,00 |
| | | | | | | | $ (248) | $ (592) | (0,21) |

[1] Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF INDUSTRIE-, STAATS- UND US-KOMMUNALEMMISSIONEN – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Kontrahent | Referenzeinheit | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits- datum | Nenn- betrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | Mexico Government International Bond | 1,000 % | 20.12.2023 | $ 1.550 | $ (30) | $ 30 | $ 0 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 700 | (11) | 7 | (4) | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.06.2022 | 600 | (36) | 4 | (32) | (0,01) |
| BRC | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.06.2023 | 500 | (27) | (14) | (41) | (0,02) |
| CBK | Brazil Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 500 | (18) | 7 | (11) | 0,00 |
| | Italy Government International Bond | 1,000 | 20.12.2021 | 1.500 | (44) | 48 | 4 | 0,00 |
| | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.06.2024 | 1.000 | (18) | 13 | (5) | 0,00 |
| | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.06.2023 | 100 | (6) | (2) | (8) | 0,00 |
| DUB | Petroleos Mexicanos | 1,000 | 20.12.2021 | 100 | (9) | 5 | (4) | 0,00 |
| GST | Mexico Government International Bond | 1,000 | 20.12.2023 | 700 | (15) | 15 | 0 | 0,00 |
| | | | | | $ (214) | $ 113 | $ (101) | (0,03) |

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZVERKAUF[1]**

| Kontrahent | Index/Tranchen | Zu erhaltender Festzinssatz | Fälligkeits- datum | Nenn- betrag[2] | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BPS | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 % | 20.12.2023 | $ 100 | $ 12 | $ 4 | $ 16 | 0,01 |
| CBK | CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2021 | 1.300 | 127 | 26 | 153 | 0,05 |
| | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 100 | 10 | 6 | 16 | 0,01 |
| GST | CDX.HY-27 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2021 | 100 | 9 | 3 | 12 | 0,00 |
| | CDX.HY-29 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2022 | 100 | 14 | 1 | 15 | 0,01 |
| | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 400 | 48 | 15 | 63 | 0,02 |
| | CMBX.NA.AAA.9 Index | 0,500 | 17.09.2058 | 5.700 | (212) | 270 | 58 | 0,02 |
| JPM | CDX.HY-31 5-Year Index 25-35 % | 5,000 | 20.12.2023 | 300 | 33 | 14 | 47 | 0,01 |
| MYC | CMBX.NA.AAA.10 Index | 0,500 | 17.11.2059 | 100 | (3) | 4 | 1 | 0,00 |
| | | | | | $ 38 | $ 343 | $ 381 | 0,13 |

[1] Agiert der Teilfonds als Verkäufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann zahlt der Teilfonds entweder (i) dem Sicherungsnehmer einen Betrag, der dem Nennwert des Swaps entspricht, und erhält die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er zahlt einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

[2] Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

**TOTAL RETURN SWAPS AUF INDIZES**

| Kontrahent | Zahlung/ Erhalt | Wertpapier | Anzahl der Anteile oder Einheiten | Variabler Zinssatz | Nennbetrag | Fälligkeits- datum | Gezahlte/ (erhaltene) Abschluss- prämien | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | Markt- wert | % des Nettover- mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| MYC | Erhalt | iBoxx USD Liquid High Yield Index | k. A. | 3-Month USD-LIBOR zzgl. eines bestimmten Spreads | $ 900 | 20.12.2019 | $ (5) | $ 34 | $ 29 | 0,01 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Investment Grade Corporate Bond Fund (Forts.)

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 714 | PLN | 2.671 | $ 2 | $ 0 | $ 2 | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | ARS | 36.029 | $ | 727 | 0 | (87) | (87) | (0,03) |
| | 07/2019 | € | 347 | | 389 | 0 | (6) | (6) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 79 | ARS | 3.934 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 5.866 | £ | 4.625 | 20 | 0 | 20 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 628 | PEN | 2.071 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 08/2019 | £ | 4.625 | $ | 5.875 | 0 | (20) | (20) | (0,01) |
| | 08/2019 | PEN | 3.189 | | 956 | 0 | (13) | (13) | 0,00 |
| | 08/2019 | $ | 1.428 | BRL | 5.511 | 6 | 0 | 6 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 465 | MXN | 9.086 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 420 | RUB | 27.414 | 12 | 0 | 12 | 0,00 |
| | 09/2019 | PEN | 2.071 | $ | 627 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| BRC | 08/2019 | $ | 109 | MXN | 2.101 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 10/2019 | | 375 | | 7.337 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | COP | 1.559.033 | $ | 489 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 07/2019 | € | 345 | | 393 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 726 | | 919 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 07/2019 | ¥ | 12.800 | | 117 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 2.018 | | 605 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 124 | ARS | 6.034 | 13 | 0 | 13 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 461 | COP | 1.559.033 | 25 | 0 | 25 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 11.198 | € | 9.853 | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| | 08/2019 | € | 9.509 | $ | 10.835 | 0 | (22) | (22) | (0,01) |
| | 08/2019 | MXN | 6.112 | | 311 | 0 | (5) | (5) | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 487 | COP | 1.559.033 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 9.181 | $ | 10.253 | 0 | (202) | (202) | (0,07) |
| | 07/2019 | $ | 107 | HUF | 30.386 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 527 | RUB | 35.002 | 27 | 0 | 27 | 0,01 |
| JPM | 07/2019 | € | 311 | $ | 351 | 0 | (4) | (4) | 0,00 |
| | 07/2019 | £ | 72 | | 92 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | HUF | 10.389 | | 38 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 07/2019 | PEN | 53 | | 16 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 374 | € | 331 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 269 | ZAR | 3.922 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 40 | £ | 32 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 119 | ¥ | 12.800 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 12.800 | $ | 119 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 3.827 | | 4.843 | 0 | (27) | (27) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ | 415 | ZAR | 5.912 | 4 | 0 | 4 | 0,00 |
| | 09/2019 | | 687 | IDR | 10.071.664 | 19 | 0 | 19 | 0,01 |
| | | | | | | $ 184 | $ (406) | $ (222) | (0,08) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € | 37.400 | $ | 42.501 | $ 0 | $ (90) | $ (90) | (0,03) |
| | 08/2019 | $ | 42.609 | € | 37.400 | 90 | 0 | 90 | 0,03 |
| BPS | 07/2019 | € | 35.695 | $ | 40.586 | 0 | (64) | (64) | (0,02) |
| | 07/2019 | $ | 875 | € | 775 | 7 | 0 | 7 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 40.689 | | 35.695 | 65 | 0 | 65 | 0,02 |
| BRC | 07/2019 | | 38.298 | | 34.244 | 699 | 0 | 699 | 0,24 |
| CBK | 07/2019 | € | 37.400 | $ | 42.505 | 0 | (86) | (86) | (0,03) |
| | 07/2019 | $ | 78 | € | 69 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | | 42.613 | | 37.400 | 87 | 0 | 87 | 0,03 |
| GLM | 07/2019 | | 43.822 | | 39.174 | 789 | 0 | 789 | 0,27 |
| MYI | 07/2019 | | 38.292 | | 34.244 | 706 | 0 | 706 | 0,25 |
| SCX | 07/2019 | | 2.242 | | 1.990 | 24 | 0 | 24 | 0,01 |
| | | | | | | $ 2.467 | $ (240) | $ 2.227 | 0,77 |

Zum 30. Juni 2019 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 Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | £ | 114 | $ | 144 | $ 0 | $ (1) | $ (1) | 0,00 |
| BPS | 07/2019 | | 5.289 | | 6.708 | 0 | (23) | (23) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ | 6.552 | £ | 5.158 | 23 | 0 | 23 | 0,01 |
| CBK | 07/2019 | £ | 5.190 | $ | 6.594 | 0 | (11) | (11) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 6.578 | £ | 5.192 | 29 | 0 | 29 | 0,01 |
| | 08/2019 | | 6.535 | | 5.136 | 11 | 0 | 11 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | £ | 39 | $ | 49 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 99 | £ | 79 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | | 112 | | 88 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | | 6.571 | | 5.192 | 36 | 0 | 36 | 0,01 |

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | Zu erhaltende Währung | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SSB | 07/2019 | £ 110 | $ 139 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 6.357 | £ 5.031 | 46 | 0 | 46 | 0,02 |
| | | | | $ 146 | $ (35) | $ 111 | 0,04 |
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | | | | | | **$ 2.536** | **0,88** |

**LEERVERKAUFTE WERTPAPIERE**

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae UMBS, TBA** | | | |
| 3,000 % fällig am 01.08.2049 | $ 400 | $ (403) | (0,14) |
| **Summe Leerverkaufte Wertpapiere** | | **$ (403)** | **(0,14)** |
| **Summe Anlagen** | | **$ 362.557** | **125,68** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | | **$ (74.080)** | **(25,68)** |
| **Nettovermögen** | | **$ 288.477** | **100,00** |

## ERLÄUTERUNGEN ZUR AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERANLAGEN (Angaben in Tausend*):

* Auf Null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt.

^ Das Wertpapier ist in Verzug.

(a) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.

(b) Wertpapier mit Sachwertausschüttung.

(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 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 47.150 als Sicherheiten verpfändet.

(h) Gemäß den Rahmenverträgen für Wertpapier-Termingeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 7.767 als Sicherheiten verpfändet.

Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 338 als Sicherheiten erhalten.

Barmittel in Höhe von USD 3.040 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.

(i) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 705 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (722) | $ 705 | $ 705 | 0,24 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (722)** | **$ 705** | **$ 705** | **0,24** |

[1] Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 590 | $ 360.397 | $ 0 | $ 360.987 |
| Finanzderivate[3] | 58 | 1.915 | 0 | 1.973 |
| Leerverkäufe | 0 | (403) | 0 | (403) |
| **Summen** | **$ 648** | **$ 361.909** | **$ 0** | **$ 362.557** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 259 | $ 236.377 | $ 94 | $ 236.730 |
| Finanzderivate[3] | (70) | (930) | 0 | (1.000) |
| **Summen** | **$ 189** | **$ 235.447** | **$ 94** | **$ 235.730** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Verbindlich-keiten aus Pensions-geschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BOS | 1,850 % | 25.06.2019 | 09.07.2019 | $ (14.736) | $ (14.741) | (5,11) |
| | 2,400 | 13.06.2019 | 15.07.2019 | (6.026) | (6.033) | (2,09) |
| | 2,450 | 25.06.2019 | 10.07.2019 | (6.642) | (6.650) | (2,31) |
| | 2,520 | 25.06.2019 | 09.07.2019 | (10.918) | (10.922) | (3,79) |
| | 2,750 | 18.06.2019 | 02.07.2019 | (4.624) | (4.629) | (1,60) |
| SCX | 2,710 | 14.06.2019 | 05.07.2019 | (4.042) | (4.047) | (1,40) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (47.022)** | **(16,30)** |

**Ausstehende Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Zahlbar für Rückkauf-geschäfte[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| BPG | 2,640 % | 25.06.2019 | 06.08.2019 | $ (7.760) | $ (7.764) | (2,69) |
| **Summe Rückkaufgeschäfte** | | | | | **$ (7.764)** | **(2,69)** |

(1) Die Verbindlichkeiten für Rückkaufgeschäfte umfassen einen aufgeschobenen Preisrückgang von USD 20.

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ 60 | $ 0 | $ 60 |
| BPS | (86) | 0 | (86) |
| BRC | 657 | (690) | (33) |
| CBK | 198 | 0 | 198 |
| DUB | (4) | 0 | (4) |
| GLM | 678 | (600) | 78 |
| GST | 147 | 0 | 147 |
| JPM | 55 | 0 | 55 |
| MYC | 23 | 0 | 23 |
| MYI | 706 | (500) | 206 |
| SCX | 56 | 0 | 56 |
| SSB | 46 | 0 | 46 |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 89,65 | 89,15 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 35,25 | 43,05 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,24 | 0,25 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,02 | (0,04) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (0,22) | (0,46) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,88 | (0,06) |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,14) | 0,00 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (16,30) | (27,08) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | (2,69) | 0,00 |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Kreditbeteiligungen und -abtretung | 1,91 | 3,22 |
| Unternehmensanleihen und Wechsel | 91,37 | 78,50 |
| US-Regierungsbehörden | 9,30 | 8,16 |
| US-Schatzobligationen | 20,72 | 40,61 |
| Non-Agency-MBS | 0,14 | 0,22 |
| Forderungsbesicherte Wertpapiere | 0,05 | 0,00 |
| Staatsemissionen | 1,20 | 1,16 |
| Vorzugswertpapiere | 0,00 | 0,04 |
| Kurzfristige Instrumente | 0,25 | 0,44 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 0,20 | 0,10 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,02 | (0,04) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | 0,02 | (0,05) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | 0,00 | 0,03 |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,06 | (0,22) |
| Zinsswaps | (0,30) | (0,22) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Optionskauf | | |
| Devisenoptionen | 0,00 | 0,01 |
| Zinsswapoption | 0,25 | 0,21 |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,02) |
| Zinsswapoption | (0,21) | (0,19) |
| Credit Default Swaps auf Industrie-, Staats- und US-Kommunalemmissionen – Schutzverkauf | (0,03) | (0,12) |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzverkauf | 0,13 | 0,07 |
| Total Return Swaps auf Indizes | 0,01 | (0,01) |
| Devisenterminkontrakte | (0,08) | (0,05) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,81 | 0,04 |
| Leerverkaufte Wertpapiere | (0,14) | 0,00 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (25,68) | (31,89) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE UND GELDMARKTINSTRUMENTE - AMTLICHE BÖRSE/GEREGELTER MARKT** | | | | |
| **AUSTRALIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Macquarie Group Ltd.** | | | | |
| 3,541 % fällig am 28.11.2023 | $ | 500 | $ 501 | 0,02 |
| 3,661 % fällig am 27.03.2024 | | 4.800 | 4.826 | 0,20 |
| **Pacific National Finance Pty. Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 23.09.2020 | | 1.050 | 1.071 | 0,04 |
| **Woodside Finance Ltd.** | | | | |
| 4,600 % fällig am 10.05.2021 | | 2.550 | 2.629 | 0,11 |
| **Woolworths Group Ltd.** | | | | |
| 4,000 % fällig am 22.09.2020 | | 700 | 712 | 0,03 |
| | | | 9.739 | 0,40 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **FirstMac Mortgage Funding Trust** | | | | |
| 3,212 % fällig am 08.03.2049 | | 1.317 | 1.315 | 0,06 |
| **Liberty Funding Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,618 % fällig am 10.10.2049 | AUD | 369 | 259 | 0,01 |
| **Pepper Residential Securities Trust** | | | | |
| 2,400 % fällig am 13.08.2057 | | 776 | 544 | 0,02 |
| | | | 2.118 | 0,09 |
| Summe Australien | | | 11.857 | 0,49 |
| **BERMUDA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aircastle Ltd.** | | | | |
| 5,125 % fällig am 15.03.2021 | $ | 1.000 | 1.037 | 0,04 |
| 6,250 % fällig am 01.12.2019 | | 3.000 | 3.043 | 0,13 |
| 7,625 % fällig am 15.04.2020 | | 4.700 | 4.873 | 0,20 |
| Summe Bermuda | | | 8.953 | 0,37 |
| **KANADA** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **CARDS Trust** | | | | |
| 2,654 % fällig am 17.10.2022 | | 4.000 | 4.000 | 0,16 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Enbridge, Inc.** | | | | |
| 2,984 % fällig am 10.01.2020 | | 7.400 | 7.402 | 0,31 |
| 3,110 % fällig am 15.06.2020 | | 1.000 | 1.003 | 0,04 |
| | | | 8.405 | 0,35 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **CPPIB Capital, Inc.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.01.2021 | | 6.000 | 6.042 | 0,25 |
| **Export Development Canada** | | | | |
| 2,552 % fällig am 19.07.2019 | | 18.000 | 18.000 | 0,75 |
| | | | 24.042 | 1,00 |
| Summe Kanada | | | 36.447 | 1,51 |
| **CAYMAN INSELN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **B&M CLO Ltd.** | | | | |
| 3,331 % fällig am 16.04.2026 | | 3.194 | 3.191 | 0,13 |
| **Benefit Street Partners CLO Ltd.** | | | | |
| 3,381 % fällig am 18.07.2027 | | 1.500 | 1.497 | 0,06 |
| **Black Diamond CLO Ltd.** | | | | |
| 3,638 % fällig am 06.02.2026 | | 1.544 | 1.544 | 0,06 |
| **CIFC Funding Ltd.** | | | | |
| 3,440 % fällig am 25.10.2027 | | 1.800 | 1.791 | 0,07 |
| **Figueroa CLO Ltd.** | | | | |
| 3,237 % fällig am 20.06.2027 | | 4.000 | 3.990 | 0,17 |
| 3,497 % fällig am 15.01.2027 | | 3.857 | 3.855 | 0,16 |
| **Gallatin CLO Ltd.** | | | | |
| 3,642 % fällig am 21.01.2028 | | 4.700 | 4.696 | 0,20 |
| 3,647 % fällig am 15.07.2027 | | 1.200 | 1.199 | 0,05 |
| **Jamestown CLO Ltd.** | | | | |
| 3,287 % fällig am 15.07.2026 | | 832 | 831 | 0,04 |
| 3,467 % fällig am 15.01.2028 | | 2.500 | 2.492 | 0,10 |
| **Mountain View CLO Ltd.** | | | | |
| 3,417 % fällig am 13.10.2027 | $ | 3.000 | $ 2.989 | 0,12 |
| **Neuberger Berman CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | | 1.500 | 1.499 | 0,06 |
| **OCP CLO Ltd.** | | | | |
| 3,397 % fällig am 15.07.2027 | | 2.500 | 2.495 | 0,10 |
| **Octagon Investment Partners Ltd.** | | | | |
| 3,447 % fällig am 15.07.2027 | | 3.800 | 3.792 | 0,16 |
| **Palmer Square CLO Ltd.** | | | | |
| 3,368 % fällig am 15.08.2026 | | 2.494 | 2.484 | 0,10 |
| **Telos CLO Ltd.** | | | | |
| 3,538 % fällig am 17.04.2028 | | 6.000 | 5.988 | 0,25 |
| **Tralee CLO Ltd.** | | | | |
| 3,622 % fällig am 20.10.2027 | | 3.500 | 3.501 | 0,15 |
| **Venture CLO Ltd.** | | | | |
| 3,667 % fällig am 15.04.2027 | | 9.100 | 9.078 | 0,38 |
| **Voya CLO Ltd.** | | | | |
| 3,300 % fällig am 25.07.2026 | | 926 | 925 | 0,04 |
| | | | 57.837 | 2,40 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **ADCB Finance Cayman Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 16.09.2019 | | 1.000 | 1.000 | 0,04 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.01.2023 | | 1.400 | 1.496 | 0,06 |
| **HPHT Finance Ltd.** | | | | |
| 2,875 % fällig am 17.03.2020 | | 2.000 | 2.005 | 0,08 |
| **Hutchison Whampoa International Ltd.** | | | | |
| 4,625 % fällig am 13.01.2022 | | 1.500 | 1.576 | 0,06 |
| **Park Aerospace Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.03.2021 | | 700 | 708 | 0,03 |
| 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 2.500 | 2.646 | 0,11 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,576 % fällig am 02.05.2022 | | 6.400 | 6.448 | 0,27 |
| 3,872 % fällig am 31.05.2021 | | 3.000 | 3.041 | 0,13 |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 4.000 | 4.010 | 0,17 |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 8.000 | 8.020 | 0,33 |
| 3,985 % fällig am 11.08.2021 | | 2.600 | 2.607 | 0,11 |
| **Tencent Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,491 % fällig am 11.04.2024 | | 4.400 | 4.404 | 0,18 |
| | | | 37.961 | 1,57 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **GPMT Ltd.** | | | | |
| 3,283 % fällig am 21.11.2035 | | 2.208 | 2.212 | 0,09 |
| Summe Cayman Inseln | | | 98.010 | 4,06 |
| **CHILE** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Banco Santander Chile** | | | | |
| 3,380 % fällig am 25.07.2020 | | 3.400 | 3.409 | 0,14 |
| 3,721 % fällig am 28.11.2021 | | 3.000 | 3.053 | 0,13 |
| **Itau CorpBanca** | | | | |
| 3,875 % fällig am 22.09.2019 | | 5.000 | 5.017 | 0,21 |
| Summe Chile | | | 11.479 | 0,48 |
| **CHINA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **CNPC General Capital Ltd.** | | | | |
| 2,700 % fällig am 25.11.2019 | | 1.500 | 1.503 | 0,06 |
| **Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.** | | | | |
| 3,500 % fällig am 30.07.2020 | | 900 | 907 | 0,04 |
| **Shanghai Electric Group Global Investment Ltd.** | | | | |
| 3,000 % fällig am 14.08.2019 | | 1.000 | 1.000 | 0,04 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 2,250 % fällig am 13.09.2020 | | 2.500 | 2.496 | 0,10 |
| 2,375 % fällig am 12.04.2020 | | 2.000 | 2.000 | 0,08 |
| 2,500 % fällig am 28.04.2020 | | 5.900 | 5.901 | 0,25 |
| Summe China | | | 13.807 | 0,57 |
| **CURACAO** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Teva Pharmaceutical Finance Co. BV** | | | | |
| 3,650 % fällig am 10.11.2021 | | 500 | 483 | 0,02 |
| **DÄNEMARK** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Danske Bank A/S** | | | | |
| 1,650 % fällig am 06.09.2019 | $ | 1.500 | $ 1.497 | 0,06 |
| 3,496 % fällig am 12.09.2023 | | 2.300 | 2.236 | 0,09 |
| Summe Dänemark | | | 3.733 | 0,15 |
| **FINNLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Nordea Bank Abp** | | | | |
| 3,511 % fällig am 27.05.2021 | | 2.000 | 2.025 | 0,08 |
| **FRANKREICH** | | | | |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Agence Francaise de Developpement** | | | | |
| 2,592 % fällig am 07.06.2021 | | 1.000 | 1.003 | 0,04 |
| **SNCF Reseau** | | | | |
| 2,000 % fällig am 13.10.2020 | | 5.000 | 4.994 | 0,21 |
| Summe Frankreich | | | 5.997 | 0,25 |
| **DEUTSCHLAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Erste Abwicklungsanstalt** | | | | |
| 2,663 % fällig am 09.03.2020 | | 2.000 | 2.003 | 0,08 |
| **HSH Portfoliomanagement AoeR** | | | | |
| 2,850 % fällig am 19.11.2021 | | 6.000 | 6.041 | 0,25 |
| Summe Deutschland | | | 8.044 | 0,33 |
| **GUERNSEY, KANALINSELN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | | |
| 4,891 % fällig am 16.04.2021 | | 7.560 | 7.803 | 0,32 |
| **HONGKONG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AIA Group Ltd.** | | | | |
| 2,907 % fällig am 20.09.2021 | | 15.900 | 15.900 | 0,66 |
| **China Shenhua Overseas Capital Co. Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 20.01.2020 | | 7.000 | 7.012 | 0,29 |
| **CNOOC Finance Australia Pty. Ltd.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 05.05.2020 | | 12.940 | 12.965 | 0,54 |
| **Sinochem Overseas Capital Co. Ltd.** | | | | |
| 4,500 % fällig am 12.11.2020 | | 3.790 | 3.889 | 0,16 |
| Summe Hongkong | | | 39.766 | 1,65 |
| **INDIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Axis Bank Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 21.05.2020 | | 4.000 | 4.009 | 0,17 |
| **ICICI Bank Ltd.** | | | | |
| 3,125 % fällig am 12.08.2020 | | 3.000 | 3.009 | 0,12 |
| 3,500 % fällig am 18.03.2020 | | 2.270 | 2.280 | 0,09 |
| **State Bank of India** | | | | |
| 3,539 % fällig am 06.04.2020 | | 7.100 | 7.117 | 0,30 |
| | | | 16.415 | 0,68 |
| **STAATSEMISSIONEN** | | | | |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 2,750 % fällig am 01.04.2020 | | 4.500 | 4.508 | 0,19 |
| 2,750 % fällig am 12.08.2020 | | 900 | 902 | 0,04 |
| 3,522 % fällig am 21.08.2022 | | 11.200 | 11.206 | 0,46 |
| | | | 16.616 | 0,69 |
| Summe Indien | | | 33.031 | 1,37 |
| **IRLAND** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Black Diamond CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 3,646 % fällig am 03.10.2029 | | 3.300 | 3.309 | 0,14 |
| **Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC** | | | | |
| 0,730 % fällig am 21.09.2029 | € | 2.100 | 2.393 | 0,10 |
| **Cork Street CLO Designated Activity Co.** | | | | |
| 0,590 % fällig am 27.11.2028 | | 1.400 | 1.601 | 0,06 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **Dartry Park CLO DAC** | | | | |
| 0,830 % fällig am 28.04.2029 | € | 1.500 | $ 1.710 | 0,07 |
| **Dorchester Park CLO DAC** | | | | |
| 3,492 % fällig am 20.04.2028 | $ | 2.000 | 1.988 | 0,08 |
| **Harvest CLO DAC** | | | | |
| 0,630 % fällig am 18.11.2029 | € | 600 | 683 | 0,03 |
| | | | 11.684 | 0,48 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **AerCap Ireland Capital DAC** | | | | |
| 3,950 % fällig am 01.02.2022 | | 1.000 | 1.029 | 0,04 |
| 4,250 % fällig am 01.07.2020 | | 300 | 305 | 0,01 |
| 4,450 % fällig am 16.12.2021 | | 4.650 | 4.830 | 0,20 |
| 4,500 % fällig am 15.05.2021 | | 600 | 619 | 0,03 |
| 4,625 % fällig am 30.10.2020 | | 2.400 | 2.462 | 0,10 |
| 5,000 % fällig am 01.10.2021 | | 1.300 | 1.364 | 0,06 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | | 2.000 | 1.991 | 0,08 |
| **Iberdrola Finance Ireland DAC** | | | | |
| 5,000 % fällig am 11.09.2019 | | 500 | 502 | 0,02 |
| **SMBC Aviation Capital Finance DAC** | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.07.2021 | | 3.500 | 3.500 | 0,15 |
| 3,000 % fällig am 15.07.2022 | | 3.100 | 3.140 | 0,13 |
| 3,550 % fällig am 15.04.2024 | | 2.600 | 2.677 | 0,11 |
| | | | 22.419 | 0,93 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **BÖRSENGEHANDELTE FONDS** | | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (e)** | | 393.850 | 39.972 | 1,66 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | |
| **Taurus UK DAC** | | | | |
| 1,654 % fällig am 17.11.2027 | £ | 2.481 | 3.145 | 0,13 |
| Summe Irland | | | 77.220 | 3,20 |
| **ISRAEL** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Israel Electric Corp. Ltd.** | | | | |
| 9,375 % fällig am 28.01.2020 | $ | 6.500 | 6.754 | 0,28 |
| **JAPAN** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **OSCAR U.S. Funding Trust LLC** | | | | |
| 3,150 % fällig am 10.08.2021 | | 1.320 | 1.325 | 0,06 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Aozora Bank Ltd.** | | | | |
| 2,750 % fällig am 09.03.2020 | | 3.100 | 3.102 | 0,13 |
| 3,810 % fällig am 07.09.2021 | | 4.300 | 4.397 | 0,18 |
| **Central Nippon Expressway Co. Ltd.** | | | | |
| 2,091 % fällig am 14.09.2021 | | 8.500 | 8.419 | 0,35 |
| 2,241 % fällig am 16.02.2021 | | 1.100 | 1.098 | 0,05 |
| 2,381 % fällig am 17.09.2020 | | 1.700 | 1.701 | 0,07 |
| 2,567 % fällig am 02.11.2021 | | 3.000 | 3.011 | 0,12 |
| 2,978 % fällig am 15.02.2022 | | 29.600 | 29.529 | 1,22 |
| 3,125 % fällig am 02.11.2021 | | 3.800 | 3.804 | 0,16 |
| 3,278 % fällig am 14.09.2021 | | 500 | 504 | 0,02 |
| 3,330 % fällig am 03.03.2022 | | 500 | 503 | 0,02 |
| 3,521 % fällig am 28.05.2021 | | 500 | 505 | 0,02 |
| **Chugoku Electric Power Co., Inc.** | | | | |
| 2,701 % fällig am 16.03.2020 | | 2.500 | 2.502 | 0,10 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,172 % fällig am 07.03.2022 | | 2.300 | 2.308 | 0,10 |
| 3,260 % fällig am 02.03.2023 | | 4.100 | 4.101 | 0,17 |
| 3,370 % fällig am 25.07.2022 | | 14.200 | 14.252 | 0,59 |
| 3,443 % fällig am 22.02.2022 | | 5.000 | 5.045 | 0,21 |
| 3,510 % fällig am 13.09.2021 | | 5.600 | 5.661 | 0,23 |
| **Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co. Ltd.** | | | | |
| 2,500 % fällig am 09.03.2020 | | 3.994 | 3.974 | 0,16 |
| 2,652 % fällig am 19.09.2022 | | 8.500 | 8.510 | 0,35 |
| 2,750 % fällig am 21.10.2020 | | 600 | 602 | 0,02 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,331 % fällig am 11.09.2022 | $ | 14.400 | $ 14.488 | 0,60 |
| 3,461 % fällig am 28.02.2022 | | 1.000 | 1.009 | 0,04 |
| 3,590 % fällig am 13.09.2021 (f) | | 9.950 | 10.080 | 0,42 |
| **NTT Finance Corp.** | | | | |
| 2,860 % fällig am 29.06.2020 | | 5.000 | 5.011 | 0,21 |
| **ORIX Corp.** | | | | |
| 2,650 % fällig am 13.04.2021 | | 14.100 | 14.137 | 0,59 |
| 2,900 % fällig am 18.07.2022 | | 600 | 609 | 0,03 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** | | | | |
| 2,971 % fällig am 16.10.2020 | | 1.000 | 1.002 | 0,04 |
| **Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.** | | | | |
| 3,341 % fällig am 18.10.2022 | | 4.500 | 4.511 | 0,19 |
| 3,384 % fällig am 12.07.2022 | | 6.400 | 6.428 | 0,27 |
| 3,707 % fällig am 14.07.2021 | | 900 | 911 | 0,04 |
| **Suntory Holdings Ltd.** | | | | |
| 2,550 % fällig am 29.09.2019 | | 2.000 | 1.999 | 0,08 |
| **Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.** | | | | |
| 3,800 % fällig am 26.11.2020 | | 10.600 | 10.796 | 0,45 |
| | | | 174.509 | 7,23 |
| Summe Japan | | | 175.834 | 7,29 |
| **LUXEMBURG** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Allergan Funding SCS** | | | | |
| 3,000 % fällig am 12.03.2020 | | 5.500 | 5.517 | 0,23 |
| 3,691 % fällig am 12.03.2020 | | 5.800 | 5.838 | 0,24 |
| **Holcim U.S. Finance SARL & Cie SCS** | | | | |
| 6,000 % fällig am 30.12.2019 | | 2.850 | 2.890 | 0,12 |
| **Pentair Finance SARL** | | | | |
| 3,625 % fällig am 15.09.2020 | | 5.000 | 5.024 | 0,21 |
| | | | 19.269 | 0,80 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Delos Finance SARL** | | | | |
| 4,080 % fällig am 06.10.2023 | | 250 | 250 | 0,01 |
| Summe Luxemburg | | | 19.519 | 0,81 |
| **MALAYSIA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Petronas Global Sukuk Ltd.** | | | | |
| 2,707 % fällig am 18.03.2020 | | 2.500 | 2.505 | 0,10 |
| **NIEDERLANDE** | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | |
| **Cairn CLO BV** | | | | |
| 0,930 % fällig am 30.04.2031 | € | 1.100 | 1.258 | 0,05 |
| **Contego CLO BV** | | | | |
| 0,599 % fällig am 15.11.2026 | | 2.390 | 2.722 | 0,11 |
| **Tikehau CLO BV** | | | | |
| 0,600 % fällig am 04.08.2028 | | 2.000 | 2.275 | 0,10 |
| | | | 6.255 | 0,26 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Cooperatieve Rabobank UA** | | | | |
| 3,064 % fällig am 10.01.2023 | $ | 5.000 | 4.980 | 0,21 |
| **Deutsche Telekom International Finance BV** | | | | |
| 1,500 % fällig am 19.09.2019 | | 3.100 | 3.094 | 0,13 |
| **ING Groep NV** | | | | |
| 3,320 % fällig am 02.10.2023 | | 1.000 | 999 | 0,04 |
| 3,480 % fällig am 29.03.2022 | | 2.700 | 2.734 | 0,11 |
| **Mylan NV** | | | | |
| 3,150 % fällig am 15.06.2021 | | 2.700 | 2.701 | 0,11 |
| 3,750 % fällig am 15.12.2020 | | 6.500 | 6.563 | 0,27 |
| **NXP BV** | | | | |
| 4,125 % fällig am 01.06.2021 | | 3.600 | 3.692 | 0,15 |
| 4,625 % fällig am 15.06.2022 | | 2.000 | 2.100 | 0,09 |
| **Syngenta Finance NV** | | | | |
| 3,698 % fällig am 24.04.2020 | | 11.975 | 12.061 | 0,50 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** | | | | |
| 1,700 % fällig am 19.07.2019 | | 5.600 | 5.585 | 0,23 |
| 2,200 % fällig am 21.07.2021 | | 1.400 | 1.333 | 0,06 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | | |
| 4,000 % fällig am 12.08.2020 | $ | 1.400 | $ 1.423 | 0,06 |
| | | | 47.265 | 1,96 |
| Summe Niederlande | | | 53.520 | 2,22 |
| **NEUSEELAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BNZ International Funding Ltd.** | | | | |
| 3,408 % fällig am 14.09.2021 | | 2.500 | 2.528 | 0,11 |
| **NORWEGEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **DNB Bank ASA** | | | | |
| 3,590 % fällig am 02.06.2021 | | 2.000 | 2.028 | 0,08 |
| **Eksportfinans ASA** | | | | |
| 3,345 % fällig am 10.11.2020 | | 1.800 | 1.802 | 0,08 |
| Summe Norwegen | | | 3.830 | 0,16 |
| **KATAR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Qatari Diar Finance Co.** | | | | |
| 5,000 % fällig am 21.07.2020 | | 4.400 | 4.513 | 0,19 |
| **Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.** | | | | |
| 5,298 % fällig am 30.09.2020 | | 500 | 510 | 0,02 |
| 6,750 % fällig am 30.09.2019 | | 2.000 | 2.018 | 0,08 |
| | | | 7.041 | 0,29 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | | |
| **Qatar National Bank SAQ** | | | | |
| 3,420 % fällig am 22.12.2020 | | 2.000 | 1.997 | 0,08 |
| Summe Katar | | | 9.038 | 0,37 |
| **SINGAPUR** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **BOC Aviation Ltd.** | | | | |
| 2,375 % fällig am 15.09.2021 | | 2.600 | 2.572 | 0,11 |
| 2,750 % fällig am 18.09.2022 | | 3.200 | 3.196 | 0,13 |
| 3,000 % fällig am 30.03.2020 | | 2.100 | 2.105 | 0,09 |
| 3,000 % fällig am 23.05.2022 | | 500 | 501 | 0,02 |
| 3,626 % fällig am 02.05.2021 | | 12.450 | 12.515 | 0,52 |
| **DBS Group Holdings Ltd.** | | | | |
| 3,200 % fällig am 25.07.2022 | | 5.300 | 5.325 | 0,22 |
| Summe Singapur | | | 26.214 | 1,09 |
| **SÜDKOREA** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Hyundai Capital Services, Inc.** | | | | |
| 2,625 % fällig am 29.09.2020 | | 500 | 500 | 0,02 |
| **SPANIEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | | |
| 5,134 % fällig am 27.04.2020 | | 3.499 | 3.571 | 0,15 |
| 5,877 % fällig am 15.07.2019 | | 4.500 | 4.505 | 0,18 |
| Summe Spanien | | | 8.076 | 0,33 |
| **SCHWEDEN** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Svenska Handelsbanken AB** | | | | |
| 2,995 % fällig am 24.05.2021 | | 2.000 | 2.010 | 0,08 |
| **SCHWEIZ** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **UBS Group Funding Switzerland AG** | | | | |
| 3,468 % fällig am 15.08.2023 | | 2.400 | 2.406 | 0,10 |
| 3,783 % fällig am 24.09.2020 | | 2.000 | 2.031 | 0,08 |
| 4,109 % fällig am 01.02.2022 | | 700 | 716 | 0,03 |
| 4,377 % fällig am 14.04.2021 | | 3.000 | 3.073 | 0,13 |
| Summe Schweiz | | | 8.226 | 0,34 |
| **THAILAND** | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | |
| **Bangkok Bank PCL** | | | | |
| 4,800 % fällig am 18.10.2020 | | 1.000 | 1.030 | 0,04 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | MARK-TWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|---|
| **Kasikornbank PCL** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 25.10.2019 | $ | 2.000 | $ | 2.008 | 0,09 |
| Summe Thailand | | | | 3.038 | 0,13 |
| **VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE** | | | | | |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Emirates NBD PJSC** | | | | | |
| 4,132 % fällig am 26.01.2020 | | 750 | | 756 | 0,03 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | | |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 17.400 | | 17.509 | 0,73 |
| Summe Vereinigte Arabische Emirate | | | | 18.265 | 0,76 |
| **GROSSBRITANNIEN** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Bumper UK Finance PLC** | | | | | |
| 1,310 % fällig am 20.09.2028 | £ | 10.900 | | 13.897 | 0,58 |
| **Penarth Master Issuer PLC** | | | | | |
| 2,932 % fällig am 18.09.2022 | $ | 1.000 | | 1.000 | 0,04 |
| | | | | 14.897 | 0,62 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Barclays PLC** | | | | | |
| 2,750 % fällig am 08.11.2019 | | 6.000 | | 5.995 | 0,25 |
| 2,875 % fällig am 08.06.2020 | | 500 | | 501 | 0,02 |
| 3,905 % fällig am 16.05.2024 | | 2.900 | | 2.859 | 0,12 |
| 3,948 % fällig am 15.02.2023 | | 9.074 | | 9.032 | 0,37 |
| 4,655 % fällig am 10.08.2021 | | 6.650 | | 6.799 | 0,28 |
| **BAT International Finance PLC** | | | | | |
| 1,625 % fällig am 09.09.2019 | | 500 | | 499 | 0,02 |
| 2,750 % fällig am 15.06.2020 | | 1.000 | | 1.003 | 0,04 |
| **BP Capital Markets PLC** | | | | | |
| 3,280 % fällig am 16.09.2021 | | 4.000 | | 4.053 | 0,17 |
| **Hitachi Capital UK PLC** | | | | | |
| 3,210 % fällig am 20.11.2020 | | 7.000 | | 7.000 | 0,29 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | | | |
| 3,086 % fällig am 11.09.2021 | | 11.200 | | 11.212 | 0,47 |
| 3,120 % fällig am 18.05.2021 | | 4.448 | | 4.452 | 0,18 |
| 3,520 % fällig am 18.05.2024 | | 19.200 | | 19.262 | 0,80 |
| **Imperial Brands Finance PLC** | | | | | |
| 2,950 % fällig am 21.07.2020 | | 7.945 | | 7.968 | 0,33 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | | | |
| 3,055 % fällig am 07.05.2021 | | 7.000 | | 7.000 | 0,29 |
| **Nationwide Building Society** | | | | | |
| 3,622 % fällig am 26.04.2023 | | 2.000 | | 2.038 | 0,08 |
| **NatWest Markets PLC** | | | | | |
| 3,719 % fällig am 29.09.2022 | | 7.500 | | 7.526 | 0,31 |
| **Natwest Markets PLC** | | | | | |
| 5,625 % fällig am 24.08.2020 | | 1.000 | | 1.032 | 0,04 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** | | | | | |
| 2,903 % fällig am 24.06.2022 | | 3.900 | | 3.888 | 0,16 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | | | |
| 3,988 % fällig am 15.05.2023 | | 21.000 | | 20.950 | 0,88 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** | | | | | |
| 2,875 % fällig am 16.10.2020 | | 4.000 | | 4.011 | 0,17 |
| **Santander UK PLC** | | | | | |
| 2,375 % fällig am 16.03.2020 | | 2.732 | | 2.732 | 0,11 |
| 2,876 % fällig am 03.11.2020 | | 916 | | 915 | 0,04 |
| 3,140 % fällig am 01.06.2021 | | 11.100 | | 11.128 | 0,46 |
| **Standard Chartered PLC** | | | | | |
| 2,250 % fällig am 17.04.2020 | | 3.166 | | 3.160 | 0,13 |
| 2,400 % fällig am 08.09.2019 | | 1.600 | | 1.600 | 0,07 |
| 3,650 % fällig am 19.08.2019 | | 7.200 | | 7.210 | 0,30 |
| **Vodafone Group PLC** | | | | | |
| 3,591 % fällig am 16.01.2024 | | 15.900 | | 15.951 | 0,66 |
| | | | | 169.776 | 7,04 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | | | |
| **Brunel Residential Mortgage Securitisation PLC** | | | | | |
| 1,041 % fällig am 13.01.2039 | £ | 1.613 | | 2.015 | 0,08 |
| **Finsbury Square PLC** | | | | | |
| 1,910 % fällig am 16.06.2069 | | 13.200 | | 16.841 | 0,70 |
| **Great Hall Mortgages PLC** | | | | | |
| 0,931 % fällig am 18.06.2038 | | 106 | | 132 | 0,01 |
| **Holmes Master Issuer PLC** | | | | | |
| 3,017 % fällig am 15.10.2054 | $ | 13.000 | | 12.995 | 0,54 |
| **Ripon Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,604 % fällig am 20.08.2056 | £ | 2.734 | $ | 3.477 | 0,14 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | | | |
| 1,654 % fällig am 20.05.2045 | | 12.745 | | 16.236 | 0,67 |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 1.800 | | 2.300 | 0,10 |
| **Trinity Square PLC** | | | | | |
| 1,971 % fällig am 15.07.2051 | | 970 | | 1.241 | 0,05 |
| **Warwick Finance Residential Mortgages PLC** | | | | | |
| 1,775 % fällig am 21.09.2049 | | 2.641 | | 3.371 | 0,14 |
| 2,275 % fällig am 21.09.2049 | | 1.456 | | 1.866 | 0,08 |
| | | | | 60.474 | 2,51 |
| Summe Großbritannien | | | | 245.147 | 10,17 |
| **USA** | | | | | |
| **FORDERUNGSBESICHERTE WERTPAPIERE** | | | | | |
| **Bayview Opportunity Master Fund Trust** | | | | | |
| 4,066 % fällig am 28.09.2033 | $ | 1.071 | | 1.083 | 0,05 |
| **Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 3,154 % fällig am 25.03.2035 | | 1.500 | | 1.480 | 0,06 |
| 5,029 % fällig am 25.03.2034 | | 115 | | 118 | 0,00 |
| **CarMax Auto Owner Trust** | | | | | |
| 1,800 % fällig am 15.03.2021 | | 612 | | 612 | 0,03 |
| **Chesapeake Funding LLC** | | | | | |
| 1,910 % fällig am 15.08.2029 | | 1.624 | | 1.616 | 0,07 |
| 3,230 % fällig am 15.08.2030 | | 887 | | 899 | 0,04 |
| **Colony American Finance Ltd.** | | | | | |
| 2,544 % fällig am 15.06.2048 | | 103 | | 103 | 0,00 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** | | | | | |
| 2,774 % fällig am 25.06.2036 | | 700 | | 688 | 0,03 |
| **EFS Volunteer LLC** | | | | | |
| 3,430 % fällig am 25.10.2035 | | 645 | | 642 | 0,03 |
| **EquiFirst Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 5,404 % fällig am 25.10.2034 | | 582 | | 599 | 0,02 |
| **First NLC Trust** | | | | | |
| 2,474 % fällig am 25.08.2037 | | 310 | | 198 | 0,01 |
| **Ford Credit Auto Lease Trust** | | | | | |
| 2,930 % fällig am 15.04.2021 | | 6.246 | | 6.260 | 0,26 |
| **Ford Credit Floorplan Master Owner Trust** | | | | | |
| 2,794 % fällig am 15.10.2023 | | 5.000 | | 5.000 | 0,21 |
| **Fremont Home Loan Trust** | | | | | |
| 3,139 % fällig am 25.01.2035 | | 800 | | 798 | 0,03 |
| **GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates** | | | | | |
| 2,654 % fällig am 25.12.2035 | | 1.307 | | 1.306 | 0,05 |
| **GM Financial Consumer Automobile Receivables Trust** | | | | | |
| 2,080 % fällig am 19.01.2021 | | 1.418 | | 1.417 | 0,06 |
| **GMF Floorplan Owner Revolving Trust** | | | | | |
| 2,714 % fällig am 15.09.2022 | | 2.500 | | 2.501 | 0,10 |
| 3,500 % fällig am 15.09.2023 | | 7.500 | | 7.706 | 0,32 |
| **Hertz Fleet Lease Funding LP** | | | | | |
| 3,230 % fällig am 10.05.2032 | | 2.000 | | 2.010 | 0,08 |
| **Home Equity Asset Trust** | | | | | |
| 3,349 % fällig am 25.06.2034 | | 1.389 | | 1.392 | 0,06 |
| **Long Beach Mortgage Loan Trust** | | | | | |
| 3,379 % fällig am 25.04.2035 | | 3.000 | | 3.020 | 0,13 |
| **LP Credit Card ABS Master Trust** | | | | | |
| 4,053 % fällig am 20.08.2024 | | 4.413 | | 4.372 | 0,18 |
| **Marlette Funding Trust** | | | | | |
| 3,710 % fällig am 15.12.2028 | | 2.120 | | 2.143 | 0,09 |
| **MASTR Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 3,104 % fällig am 25.09.2034 | | 1.437 | | 1.434 | 0,06 |
| **Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust** | | | | | |
| 3,454 % fällig am 25.09.2033 | | 1.376 | | 1.379 | 0,06 |
| **Navient Private Education Loan Trust** | | | | | |
| 2,650 % fällig am 15.12.2028 | | 288 | | 289 | 0,01 |
| **Navient Student Loan Trust** | | | | | |
| 3,430 % fällig am 15.12.2059 | | 3.962 | | 4.010 | 0,17 |
| 3,554 % fällig am 25.03.2066 | | 3.580 | | 3.597 | 0,15 |
| **Nelnet Student Loan Trust** | | | | | |
| 3,004 % fällig am 27.02.2051 | | 2.541 | | 2.543 | 0,11 |
| 3,104 % fällig am 27.09.2038 | | 4.368 | | 4.372 | 0,18 |
| 4,171 % fällig am 25.11.2024 | | 1.248 | | 1.249 | 0,05 |
| **NovaStar Mortgage Funding Trust** | | | | | |
| 3,064 % fällig am 25.01.2036 | | 2.000 | | 2.000 | 0,08 |
| **OneMain Financial Issuance Trust** | | | | | |
| 2,370 % fällig am 14.09.2032 | | 1.300 | | 1.298 | 0,05 |
| **Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust** | | | | | |
| 3,084 % fällig am 25.09.2034 | $ | 62 | $ | 63 | 0,00 |
| **Prosper Marketplace Issuance Trust** | | | | | |
| 3,350 % fällig am 15.10.2024 | | 756 | | 759 | 0,03 |
| **RAAC Trust** | | | | | |
| 3,804 % fällig am 25.05.2044 | | 1.836 | | 1.842 | 0,08 |
| **RMAT LP** | | | | | |
| 4,090 % fällig am 25.05.2048 | | 1.178 | | 1.188 | 0,05 |
| **SBA Tower Trust** | | | | | |
| 2,898 % fällig am 15.10.2044 | | 1.500 | | 1.500 | 0,06 |
| **SLC Student Loan Trust** | | | | | |
| 2,520 % fällig am 15.03.2027 | | 1.598 | | 1.591 | 0,07 |
| 2,578 % fällig am 15.05.2029 | | 2.768 | | 2.716 | 0,11 |
| **SLM Student Loan Trust** | | | | | |
| 2,854 % fällig am 25.09.2043 | | 8.158 | | 8.086 | 0,34 |
| 2,880 % fällig am 15.12.2027 | | 1.151 | | 1.153 | 0,05 |
| 3,054 % fällig am 27.12.2038 | | 1.747 | | 1.751 | 0,07 |
| 3,130 % fällig am 25.01.2028 | | 1.175 | | 1.177 | 0,05 |
| 3,180 % fällig am 25.10.2029 | | 4.000 | | 3.979 | 0,17 |
| 3,480 % fällig am 25.07.2023 | | 1.253 | | 1.252 | 0,05 |
| 4,080 % fällig am 25.04.2023 | | 1.416 | | 1.432 | 0,06 |
| 4,280 % fällig am 25.07.2023 | | 333 | | 337 | 0,01 |
| **SMB Private Education Loan Trust** | | | | | |
| 2,490 % fällig am 15.06.2027 | | 461 | | 462 | 0,02 |
| 2,980 % fällig am 15.07.2027 | | 429 | | 434 | 0,02 |
| 3,594 % fällig am 15.07.2027 | | 4.026 | | 4.056 | 0,17 |
| 3,844 % fällig am 17.02.2032 | | 351 | | 357 | 0,01 |
| **SoFi Consumer Loan Program LLC** | | | | | |
| 2,770 % fällig am 25.05.2026 | | 500 | | 501 | 0,02 |
| 3,050 % fällig am 26.12.2025 | | 128 | | 129 | 0,01 |
| 3,090 % fällig am 27.10.2025 | | 190 | | 191 | 0,01 |
| 3,260 % fällig am 25.08.2025 | | 1.149 | | 1.160 | 0,05 |
| 3,280 % fällig am 26.01.2026 | | 1.300 | | 1.310 | 0,05 |
| **SoFi Professional Loan Program LLC** | | | | | |
| 2,720 % fällig am 27.10.2036 | | 502 | | 505 | 0,02 |
| **SoFi Professional Loan Program Trust** | | | | | |
| 3,120 % fällig am 25.02.2048 | | 7.508 | | 7.571 | 0,31 |
| **Springleaf Funding Trust** | | | | | |
| 2,680 % fällig am 15.07.2030 | | 2.300 | | 2.306 | 0,10 |
| **Structured Asset Investment Loan Trust** | | | | | |
| 2,954 % fällig am 25.09.2034 | | 2.071 | | 2.036 | 0,08 |
| 3,244 % fällig am 25.08.2034 | | 259 | | 260 | 0,01 |
| **Utah State Board of Regents** | | | | | |
| 3,154 % fällig am 25.01.2057 | | 3.722 | | 3.723 | 0,15 |
| **Vericrest Opportunity Loan Transferee LLC** | | | | | |
| 3,125 % fällig am 25.09.2047 | | 2.368 | | 2.380 | 0,10 |
| **Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust** | | | | | |
| 4,129 % fällig am 25.11.2035 | | 1.775 | | 1.801 | 0,07 |
| | | | | 126.142 | 5,23 |
| **UNTERNEHMENSANLEIHEN UND WECHSEL** | | | | | |
| **Air Lease Corp.** | | | | | |
| 2,125 % fällig am 15.01.2020 | | 2.158 | | 2.153 | 0,09 |
| 2,750 % fällig am 15.01.2023 | | 1.500 | | 1.501 | 0,06 |
| 3,375 % fällig am 01.06.2021 | | 1.500 | | 1.524 | 0,06 |
| 4,750 % fällig am 01.03.2020 | | 1.000 | | 1.015 | 0,04 |
| **Allergan Sales LLC** | | | | | |
| 5,000 % fällig am 15.12.2021 | | 700 | | 732 | 0,03 |
| **Ally Financial, Inc.** | | | | | |
| 3,750 % fällig am 18.11.2019 | | 1.700 | | 1.704 | 0,07 |
| 4,125 % fällig am 30.03.2020 | | 500 | | 506 | 0,02 |
| **Altria Group, Inc.** | | | | | |
| 3,490 % fällig am 14.02.2022 | | 3.700 | | 3.807 | 0,16 |
| **American Tower Corp.** | | | | | |
| 2,800 % fällig am 01.06.2020 | | 5.000 | | 5.012 | 0,21 |
| 3,375 % fällig am 15.05.2024 | | 2.700 | | 2.779 | 0,12 |
| **Andeavor Logistics LP** | | | | | |
| 5,500 % fällig am 15.10.2019 | | 5.501 | | 5.527 | 0,23 |
| **Arrow Electronics, Inc.** | | | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2022 | | 3.250 | | 3.304 | 0,14 |
| **Assurant, Inc.** | | | | | |
| 3,583 % fällig am 26.03.2021 | | 5.200 | | 5.200 | 0,22 |
| **AT&T, Inc.** | | | | | |
| 3,418 % fällig am 15.02.2023 | | 4.400 | | 4.357 | 0,18 |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 6.132 | | 6.188 | 0,26 |
| 3,616 % fällig am 12.06.2024 | | 17.600 | | 17.834 | 0,74 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARK-TWERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **Athene Global Funding** | | | |
| 2,750 % fällig am 20.04.2020 | $ 900 | $ 902 | 0,04 |
| 3,826 % fällig am 01.07.2022 | 19.600 | 19.777 | 0,82 |
| 4,000 % fällig am 25.01.2022 | 1.000 | 1.035 | 0,04 |
| **AutoNation, Inc.** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.02.2020 | 4.500 | 4.566 | 0,19 |
| **AvalonBay Communities, Inc.** | | | |
| 3,027 % fällig am 15.01.2021 | 1.100 | 1.100 | 0,05 |
| **Aviation Capital Group LLC** | | | |
| 2,875 % fällig am 20.01.2022 | 4.900 | 4.937 | 0,20 |
| 3,253 % fällig am 30.07.2021 | 2.558 | 2.550 | 0,11 |
| 3,470 % fällig am 01.06.2021 | 3.200 | 3.217 | 0,13 |
| 6,750 % fällig am 06.04.2021 | 1.900 | 2.030 | 0,08 |
| 7,125 % fällig am 15.10.2020 | 1.000 | 1.058 | 0,04 |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 2,969 % fällig am 01.10.2021 | 2.000 | 2.006 | 0,08 |
| 3,252 % fällig am 21.07.2021 | 6.200 | 6.221 | 0,26 |
| **BAT Capital Corp.** | | | |
| 2,297 % fällig am 14.08.2020 | 7.216 | 7.203 | 0,30 |
| 3,118 % fällig am 14.08.2020 | 5.700 | 5.715 | 0,24 |
| 3,398 % fällig am 15.08.2022 | 17.110 | 17.163 | 0,71 |
| **Bayer U.S. Finance LLC** | | | |
| 2,125 % fällig am 15.07.2019 | 1.000 | 1.000 | 0,04 |
| 2,375 % fällig am 08.10.2019 | 7.500 | 7.491 | 0,31 |
| 2,979 % fällig am 25.06.2021 | 4.700 | 4.670 | 0,19 |
| 3,420 % fällig am 15.12.2023 | 4.900 | 4.815 | 0,20 |
| **Becton Dickinson and Co.** | | | |
| 2,675 % fällig am 15.12.2019 | 2.000 | 2.001 | 0,08 |
| **BGC Partners, Inc.** | | | |
| 5,125 % fällig am 27.05.2021 | 300 | 310 | 0,01 |
| **BMW U.S. Capital LLC** | | | |
| 2,898 % fällig am 14.08.2020 | 4.500 | 4.513 | 0,19 |
| 3,035 % fällig am 13.08.2021 | 7.725 | 7.750 | 0,32 |
| **BP Capital Markets America, Inc.** | | | |
| 3,069 % fällig am 19.09.2022 | 800 | 801 | 0,03 |
| **Bristol-Myers Squibb Co.** | | | |
| 2,905 % fällig am 16.05.2022 (f) | 10.800 | 10.830 | 0,45 |
| **Brixmor Operating Partnership LP** | | | |
| 3,629 % fällig am 01.02.2022 | 3.500 | 3.501 | 0,15 |
| **Broadcom Corp.** | | | |
| 2,375 % fällig am 15.01.2020 | 34.813 | 34.757 | 1,44 |
| 3,000 % fällig am 15.01.2022 | 600 | 602 | 0,03 |
| **Campbell Soup Co.** | | | |
| 3,040 % fällig am 15.03.2021 | 2.100 | 2.096 | 0,09 |
| **Cantor Fitzgerald LP** | | | |
| 7,875 % fällig am 15.10.2019 | 2.915 | 2.953 | 0,12 |
| **Cardinal Health, Inc.** | | | |
| 3,180 % fällig am 15.06.2022 | 6.885 | 6.906 | 0,29 |
| **Charter Communications Operating LLC** | | | |
| 3,579 % fällig am 23.07.2020 | 13.762 | 13.888 | 0,58 |
| 4,229 % fällig am 01.02.2024 | 12.160 | 12.219 | 0,51 |
| 4,464 % fällig am 23.07.2022 | 900 | 946 | 0,04 |
| **Cigna Corp.** | | | |
| 2,760 % fällig am 17.03.2020 | 3.000 | 3.003 | 0,12 |
| 3,060 % fällig am 17.09.2021 | 5.000 | 5.002 | 0,21 |
| 3,487 % fällig am 15.07.2023 | 6.000 | 5.999 | 0,25 |
| **Cigna Holding Co.** | | | |
| 5,125 % fällig am 15.06.2020 | 700 | 717 | 0,03 |
| **Citibank N.A.** | | | |
| 3,123 % fällig am 20.05.2022 | 9.000 | 9.015 | 0,37 |
| **Citigroup, Inc.** | | | |
| 3,543 % fällig am 01.06.2024 | 5.000 | 5.030 | 0,21 |
| **CNH Industrial Capital LLC** | | | |
| 4,375 % fällig am 06.11.2020 | 1.300 | 1.327 | 0,06 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | |
| 3,092 % fällig am 09.10.2020 | 6.500 | 6.487 | 0,27 |
| 3,342 % fällig am 22.10.2020 | 1.100 | 1.100 | 0,05 |
| **Constellation Brands, Inc.** | | | |
| 2,000 % fällig am 07.11.2019 | 5.000 | 4.989 | 0,21 |
| 3,218 % fällig am 15.11.2021 | 2.600 | 2.601 | 0,11 |
| **CVS Health Corp.** | | | |
| 3,083 % fällig am 09.03.2020 | 501 | 502 | 0,02 |
| 3,173 % fällig am 09.03.2021 | 4.800 | 4.823 | 0,20 |
| **D.R. Horton, Inc.** | | | |
| 2,550 % fällig am 01.12.2020 | 1.700 | 1.701 | 0,07 |
| **DAE Funding LLC** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.08.2020 | 600 | 602 | 0,03 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | |
| 2,450 % fällig am 18.05.2020 | $ 1.500 | $ 1.500 | 0,06 |
| 2,700 % fällig am 03.08.2020 | 1.900 | 1.905 | 0,08 |
| 2,955 % fällig am 04.05.2020 | 2.675 | 2.678 | 0,11 |
| 2,965 % fällig am 12.02.2021 | 4.925 | 4.921 | 0,20 |
| 2,973 % fällig am 22.02.2021 | 1.500 | 1.500 | 0,06 |
| 3,115 % fällig am 04.05.2021 | 10.000 | 10.005 | 0,41 |
| 3,403 % fällig am 22.02.2022 | 9.600 | 9.662 | 0,40 |
| 3,405 % fällig am 04.05.2023 | 2.000 | 2.000 | 0,08 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | 6.000 | 6.185 | 0,26 |
| **Delta Air Lines, Inc.** | | | |
| 2,875 % fällig am 13.03.2020 | 2.500 | 2.503 | 0,10 |
| **Discover Bank** | | | |
| 8,700 % fällig am 18.11.2019 | 3.000 | 3.067 | 0,13 |
| **Discovery Communications LLC** | | | |
| 2,200 % fällig am 20.09.2019 | 1.000 | 999 | 0,04 |
| 2,800 % fällig am 15.06.2020 | 195 | 195 | 0,01 |
| 3,097 % fällig am 20.09.2019 | 4.000 | 4.005 | 0,17 |
| **DISH DBS Corp.** | | | |
| 7,875 % fällig am 01.09.2019 | 200 | 201 | 0,01 |
| **Dominion Energy Gas Holdings LLC** | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2021 | 3.900 | 3.919 | 0,16 |
| **Duke Energy Corp.** | | | |
| 3,028 % fällig am 14.05.2021 | 1.500 | 1.504 | 0,06 |
| 3,101 % fällig am 11.03.2022 | 13.400 | 13.472 | 0,56 |
| **Duquesne Light Holdings, Inc.** | | | |
| 6,400 % fällig am 15.09.2020 | 500 | 522 | 0,02 |
| **DXC Technology Co.** | | | |
| 3,470 % fällig am 01.03.2021 | 4.505 | 4.505 | 0,19 |
| **Enable Oklahoma Intrastate Transmission LLC** | | | |
| 6,250 % fällig am 15.03.2020 | 1.200 | 1.227 | 0,05 |
| **Energy Transfer Operating LP** | | | |
| 4,150 % fällig am 01.10.2020 | 1.600 | 1.628 | 0,07 |
| 7,500 % fällig am 15.10.2020 | 500 | 531 | 0,02 |
| **Energy Transfer Partners LP** | | | |
| 5,750 % fällig am 01.09.2020 | 500 | 514 | 0,02 |
| **EQT Corp.** | | | |
| 3,089 % fällig am 01.10.2020 | 5.200 | 5.197 | 0,22 |
| **Equifax, Inc.** | | | |
| 3,388 % fällig am 15.08.2021 | 4.900 | 4.889 | 0,20 |
| **ERAC USA Finance LLC** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.10.2020 | 100 | 103 | 0,00 |
| **Exelon Generation Co. LLC** | | | |
| 2,950 % fällig am 15.01.2020 | 1.500 | 1.502 | 0,06 |
| 4,000 % fällig am 01.10.2020 | 1.200 | 1.218 | 0,05 |
| 5,200 % fällig am 01.10.2019 | 1.035 | 1.041 | 0,04 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 1,897 % fällig am 12.08.2019 | 1.800 | 1.798 | 0,07 |
| 2,343 % fällig am 02.11.2020 | 3.500 | 3.476 | 0,14 |
| 2,597 % fällig am 04.11.2019 | 1.500 | 1.499 | 0,06 |
| 3,006 % fällig am 02.11.2020 | 1.900 | 1.882 | 0,08 |
| 3,273 % fällig am 24.09.2020 | 9.600 | 9.593 | 0,40 |
| 3,365 % fällig am 12.08.2019 | 1.535 | 1.535 | 0,06 |
| 3,408 % fällig am 05.04.2021 | 7.097 | 7.006 | 0,29 |
| 3,495 % fällig am 04.11.2019 | 2.500 | 2.503 | 0,10 |
| 3,600 % fällig am 28.03.2022 | 500 | 492 | 0,02 |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 | 4.100 | 4.174 | 0,17 |
| 8,125 % fällig am 15.01.2020 | 2.000 | 2.057 | 0,09 |
| **Fresenius Medical Care U.S. Finance, Inc.** | | | |
| 5,625 % fällig am 31.07.2019 | 5.811 | 5.822 | 0,24 |
| **GATX Corp.** | | | |
| 3,285 % fällig am 05.11.2021 | 2.600 | 2.590 | 0,11 |
| **General Electric Co.** | | | |
| 2,200 % fällig am 09.01.2020 | 3.900 | 3.890 | 0,16 |
| 2,740 % fällig am 28.03.2020 | 2.566 | 2.560 | 0,11 |
| 4,375 % fällig am 16.09.2020 | 200 | 204 | 0,01 |
| 5,500 % fällig am 08.01.2020 | 500 | 507 | 0,02 |
| 5,550 % fällig am 04.05.2020 | 1.100 | 1.126 | 0,05 |
| 6,000 % fällig am 07.08.2019 | 6.000 | 6.020 | 0,25 |
| **General Mills, Inc.** | | | |
| 6,610 % fällig am 15.10.2022 | 2.300 | 2.424 | 0,10 |
| **General Motors Co.** | | | |
| 3,365 % fällig am 07.08.2020 | 5.820 | 5.828 | 0,24 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | |
| 2,450 % fällig am 06.11.2020 | 3.600 | 3.589 | 0,15 |
| 2,650 % fällig am 13.04.2020 | 1.000 | 1.000 | 0,04 |
| 3,442 % fällig am 09.04.2021 | 3.500 | 3.500 | 0,15 |
| 3,527 % fällig am 13.04.2020 | $ 4.335 | $ 4.348 | 0,18 |
| 3,665 % fällig am 06.11.2021 | 10.000 | 9.993 | 0,41 |
| **Georgia-Pacific LLC** | | | |
| 2,539 % fällig am 15.11.2019 | 1.000 | 1.000 | 0,04 |
| **Goldman Sachs Bank USA** | | | |
| 3,067 % fällig am 24.05.2021 | 5.277 | 5.283 | 0,22 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 3,363 % fällig am 31.10.2022 | 9.400 | 9.408 | 0,39 |
| 3,581 % fällig am 24.07.2023 | 2.500 | 2.506 | 0,10 |
| 3,688 % fällig am 15.11.2021 | 500 | 504 | 0,02 |
| 3,696 % fällig am 26.04.2022 | 3.610 | 3.641 | 0,15 |
| **Goodman U.S. Finance Two LLC** | | | |
| 6,000 % fällig am 22.03.2022 | 1.200 | 1.295 | 0,05 |
| **Harley-Davidson Financial Services, Inc.** | | | |
| 2,400 % fällig am 15.06.2020 | 1.000 | 997 | 0,04 |
| 3,022 % fällig am 21.05.2020 | 3.300 | 3.301 | 0,14 |
| 3,460 % fällig am 02.03.2021 | 5.300 | 5.294 | 0,22 |
| **Harris Corp.** | | | |
| 3,063 % fällig am 30.04.2020 | 2.000 | 2.000 | 0,08 |
| **HCA, Inc.** | | | |
| 4,250 % fällig am 15.10.2019 | 3.946 | 3.962 | 0,16 |
| 6,500 % fällig am 15.02.2020 | 22.430 | 22.948 | 0,95 |
| **Hewlett Packard Enterprise Co.** | | | |
| 2,100 % fällig am 04.10.2019 | 7.500 | 7.490 | 0,31 |
| 3,318 % fällig am 05.10.2021 | 4.000 | 4.001 | 0,17 |
| **Hyundai Capital America** | | | |
| 1,750 % fällig am 27.09.2019 | 4.500 | 4.491 | 0,19 |
| 2,000 % fällig am 01.07.2019 | 1.312 | 1.312 | 0,05 |
| 2,550 % fällig am 03.04.2020 | 100 | 100 | 0,00 |
| 2,600 % fällig am 19.03.2020 | 6.000 | 5.998 | 0,25 |
| 3,202 % fällig am 18.09.2020 | 3.800 | 3.803 | 0,16 |
| 3,256 % fällig am 12.03.2021 | 2.923 | 2.924 | 0,12 |
| 3,396 % fällig am 03.04.2020 | 1.000 | 1.003 | 0,04 |
| 3,402 % fällig am 18.09.2020 | 2.000 | 2.007 | 0,08 |
| 3,529 % fällig am 08.07.2021 | 2.300 | 2.303 | 0,10 |
| **Incitec Pivot Finance LLC** | | | |
| 6,000 % fällig am 10.12.2019 | 5.300 | 5.371 | 0,22 |
| **International Lease Finance Corp.** | | | |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | 3.400 | 3.669 | 0,15 |
| 8,625 % fällig am 15.01.2022 | 2.400 | 2.738 | 0,11 |
| **Jackson National Life Global Funding** | | | |
| 2,931 % fällig am 11.06.2021 | 2.000 | 2.006 | 0,08 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | |
| 3,012 % fällig am 18.06.2022 | 14.000 | 14.029 | 0,58 |
| 3,572 % fällig am 07.06.2021 | 4.000 | 4.052 | 0,17 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** | | | |
| 6,500 % fällig am 01.04.2020 | 900 | 926 | 0,04 |
| 6,850 % fällig am 15.02.2020 | 4.000 | 4.102 | 0,17 |
| **Kinder Morgan, Inc.** | | | |
| 3,050 % fällig am 01.12.2019 | 400 | 401 | 0,02 |
| **Komatsu Finance America, Inc.** | | | |
| 2,437 % fällig am 11.09.2022 | 2.200 | 2.198 | 0,09 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | |
| 3,115 % fällig am 10.02.2021 | 3.800 | 3.794 | 0,16 |
| 3,365 % fällig am 10.08.2022 | 2.000 | 1.992 | 0,08 |
| **Marriott International, Inc.** | | | |
| 3,103 % fällig am 08.03.2021 | 2.000 | 2.006 | 0,08 |
| 3,120 % fällig am 01.12.2020 | 6.000 | 6.025 | 0,25 |
| **Marsh & McLennan Cos., Inc.** | | | |
| 3,519 % fällig am 29.12.2021 | 2.600 | 2.608 | 0,11 |
| **Masco Corp.** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.04.2021 | 400 | 406 | 0,02 |
| **McDonald's Corp.** | | | |
| 3,012 % fällig am 28.10.2021 | 4.100 | 4.104 | 0,17 |
| **MGM Resorts International** | | | |
| 5,250 % fällig am 31.03.2020 | 400 | 408 | 0,02 |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | 4.700 | 4.923 | 0,20 |
| **Mississippi Power Co.** | | | |
| 2,961 % fällig am 27.03.2020 | 4.600 | 4.601 | 0,19 |
| **Molson Coors Brewing Co.** | | | |
| 2,250 % fällig am 15.03.2020 | 300 | 299 | 0,01 |
| **Morgan Stanley** | | | |
| 3,095 % fällig am 10.02.2021 | 1.500 | 1.502 | 0,06 |
| 3,522 % fällig am 22.07.2022 | 13.988 | 14.080 | 0,58 |
| 3,772 % fällig am 20.01.2022 | 7.800 | 7.884 | 0,33 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 6,625 % fällig am 26.07.2021 | 200 | 212 | 0,01 |
| 8,000 % fällig am 25.03.2020 | 5.200 | 5.395 | 0,22 |

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US Short-Term Fund (Forts.)

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **NextEra Energy Capital Holdings, Inc.** | | | |
| 2,921 % fällig am 21.08.2020 | $ 6.800 | $ 6.798 | 0,28 |
| 3,241 % fällig am 25.02.2022 | 5.800 | 5.835 | 0,24 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | |
| 2,125 % fällig am 03.03.2020 | 400 | 399 | 0,02 |
| 2,150 % fällig am 13.07.2020 | 2.300 | 2.291 | 0,10 |
| 2,150 % fällig am 28.09.2020 | 200 | 199 | 0,01 |
| 2,250 % fällig am 13.01.2020 | 1.684 | 1.681 | 0,07 |
| 2,720 % fällig am 28.09.2020 | 1.500 | 1.499 | 0,06 |
| 2,930 % fällig am 15.03.2021 | 3.960 | 3.951 | 0,16 |
| 2,970 % fällig am 13.09.2019 | 3.192 | 3.194 | 0,13 |
| 2,987 % fällig am 13.07.2020 | 13.800 | 13.802 | 0,57 |
| 3,016 % fällig am 21.09.2021 | 3.745 | 3.745 | 0,16 |
| 3,020 % fällig am 28.09.2022 | 4.400 | 4.374 | 0,18 |
| 3,247 % fällig am 13.07.2022 | 7.300 | 7.266 | 0,30 |
| 3,487 % fällig am 13.01.2022 | 1.700 | 1.702 | 0,07 |
| **OMX Timber Finance Investments LLC** | | | |
| 5,420 % fällig am 29.01.2020 | 1.000 | 1.008 | 0,04 |
| **Pennsylvania Electric Co.** | | | |
| 5,200 % fällig am 01.04.2020 | 1.500 | 1.526 | 0,06 |
| **Penske Truck Leasing Co. LP** | | | |
| 3,050 % fällig am 09.01.2020 | 2.000 | 2.003 | 0,08 |
| 3,200 % fällig am 15.07.2020 | 1.500 | 1.507 | 0,06 |
| 3,375 % fällig am 01.02.2022 | 300 | 306 | 0,01 |
| 3,650 % fällig am 29.07.2021 | 3.000 | 3.069 | 0,13 |
| **Phillips 66** | | | |
| 3,121 % fällig am 26.02.2021 | 1.700 | 1.700 | 0,07 |
| 3,347 % fällig am 15.04.2020 | 2.000 | 2.001 | 0,08 |
| **Plains All American Pipeline LP** | | | |
| 2,600 % fällig am 15.12.2019 | 4.300 | 4.297 | 0,18 |
| 5,750 % fällig am 15.01.2020 | 4.800 | 4.870 | 0,20 |
| **Protective Life Global Funding** | | | |
| 2,850 % fällig am 28.06.2021 | 1.500 | 1.506 | 0,06 |
| **QUALCOMM, Inc.** | | | |
| 2,600 % fällig am 30.01.2023 | 300 | 301 | 0,01 |
| 3,070 % fällig am 20.05.2020 | 3.000 | 3.012 | 0,12 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | |
| 3,250 % fällig am 12.06.2020 | 2.308 | 2.324 | 0,10 |
| 6,875 % fällig am 01.05.2020 | 695 | 719 | 0,03 |
| **Rockies Express Pipeline LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 15.04.2020 | 7.000 | 7.149 | 0,30 |
| **Sabine Pass Liquefaction LLC** | | | |
| 5,625 % fällig am 01.02.2021 | 1.500 | 1.558 | 0,06 |
| 6,250 % fällig am 15.03.2022 | 200 | 217 | 0,01 |
| **Santander Holdings USA, Inc.** | | | |
| 4,450 % fällig am 03.12.2021 | 700 | 728 | 0,03 |
| **Sempra Energy** | | | |
| 2,847 % fällig am 15.07.2019 | 2.100 | 2.100 | 0,09 |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | 3.300 | 3.287 | 0,14 |
| 3,097 % fällig am 15.01.2021 | 2.700 | 2.692 | 0,11 |
| **SL Green Operating Partnership LP** | | | |
| 3,505 % fällig am 16.08.2021 | 2.000 | 2.001 | 0,08 |
| **Southern Co.** | | | |
| 3,019 % fällig am 30.09.2020 | 3.100 | 3.101 | 0,13 |
| **Southern Power Co.** | | | |
| 2,937 % fällig am 20.12.2020 | 6.200 | 6.202 | 0,26 |
| **Spectra Energy Partners LP** | | | |
| 3,179 % fällig am 05.06.2020 | 1.400 | 1.404 | 0,06 |
| **Spirit AeroSystems, Inc.** | | | |
| 3,210 % fällig am 15.06.2021 | 2.600 | 2.584 | 0,11 |
| **Springleaf Finance Corp.** | | | |
| 7,750 % fällig am 01.10.2021 | 800 | 878 | 0,04 |
| 8,250 % fällig am 15.12.2020 | 250 | 269 | 0,01 |
| **Starwood Property Trust, Inc.** | | | |
| 3,625 % fällig am 01.02.2021 | 400 | 400 | 0,02 |
| **Synchrony Bank** | | | |
| 2,955 % fällig am 30.03.2020 | 250 | 250 | 0,01 |
| **Synchrony Financial** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.08.2019 | 8.291 | 8.292 | 0,34 |
| 3,806 % fällig am 03.02.2020 | 4.450 | 4.468 | 0,19 |
| **Thermo Fisher Scientific, Inc.** | | | |
| 4,700 % fällig am 01.05.2020 | 700 | 713 | 0,03 |
| **Time Warner Cable LLC** | | | |
| 4,000 % fällig am 01.09.2021 | 1.500 | 1.540 | 0,06 |
| 5,000 % fällig am 01.02.2020 | 1.885 | 1.910 | 0,08 |
| **Tyson Foods, Inc.** | | | |
| 2,972 % fällig am 21.08.2020 | 2.120 | 2.120 | 0,09 |
| 3,070 % fällig am 02.06.2020 | 5.150 | 5.156 | 0,21 |
| **United Technologies Corp.** | | | |
| 3,175 % fällig am 16.08.2021 | $ 4.731 | $ 4.734 | 0,20 |
| **Verizon Communications, Inc.** | | | |
| 3,410 % fällig am 16.03.2022 | 3.200 | 3.250 | 0,13 |
| 3,618 % fällig am 15.05.2025 | 8.700 | 8.819 | 0,37 |
| **VMware, Inc.** | | | |
| 2,300 % fällig am 21.08.2020 | 4.200 | 4.190 | 0,17 |
| 2,950 % fällig am 21.08.2022 | 2.100 | 2.118 | 0,09 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | |
| 2,400 % fällig am 22.05.2020 | 500 | 499 | 0,02 |
| 2,450 % fällig am 20.11.2019 | 13.730 | 13.725 | 0,57 |
| 3,305 % fällig am 13.11.2020 | 4.700 | 4.720 | 0,20 |
| 3,475 % fällig am 12.11.2021 | 2.000 | 2.017 | 0,08 |
| **Vulcan Materials Co.** | | | |
| 3,010 % fällig am 15.06.2020 | 2.388 | 2.389 | 0,10 |
| 3,170 % fällig am 01.03.2021 | 944 | 945 | 0,04 |
| **Wabtec Corp.** | | | |
| 3,710 % fällig am 15.09.2021 | 4.300 | 4.289 | 0,18 |
| **Wells Fargo & Co.** | | | |
| 3,611 % fällig am 26.07.2021 | 1.792 | 1.814 | 0,08 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** | | | |
| 3,102 % fällig am 22.10.2021 | 1.400 | 1.403 | 0,06 |
| 3,141 % fällig am 27.05.2022 | 3.500 | 3.508 | 0,15 |
| **WGL Holdings, Inc.** | | | |
| 2,986 % fällig am 12.03.2020 | 1.500 | 1.496 | 0,06 |
| **ZF North America Capital, Inc.** | | | |
| 4,000 % fällig am 29.04.2020 | 1.080 | 1.086 | 0,05 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | |
| 3,169 % fällig am 19.03.2021 | 5.144 | 5.140 | 0,21 |
| **Zoetis, Inc.** | | | |
| 2,960 % fällig am 20.08.2021 | 2.375 | 2.358 | 0,10 |
| | | 911.790 | 37,79 |
| **KREDITBETEILIGUNGEN UND -ABTRETUNG** | | | |
| **Las Vegas Sands, LLC** | | | |
| 4,152 % fällig am 27.03.2025 | 1.163 | 1.156 | 0,05 |
| **KOMMUNALANLEIHEN UND WECHSEL** | | | |
| **California State General Obligation Bonds, Series 2017** | | | |
| 3,211 % fällig am 01.04.2047 | 4.300 | 4.315 | 0,18 |
| **Mississippi State General Obligation Bonds, Series 2017** | | | |
| 2,830 % fällig am 01.11.2028 | 5.000 | 5.013 | 0,21 |
| **Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, Series 2006** | | | |
| 2,710 % fällig am 25.10.2036 | 1.239 | 1.232 | 0,05 |
| | | 10.560 | 0,44 |
| **NON-AGENCY-MBS** | | | |
| **American Home Mortgage Investment Trust** | | | |
| 3,004 % fällig am 25.09.2045 | 3.122 | 3.026 | 0,13 |
| **AREIT Trust** | | | |
| 3,381 % fällig am 14.11.2035 | 6.042 | 6.054 | 0,25 |
| **Atrium Hotel Portfolio Trust** | | | |
| 3,344 % fällig am 15.06.2035 | 3.000 | 3.002 | 0,12 |
| **Bancorp Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 3,294 % fällig am 15.09.2035 | 4.621 | 4.612 | 0,19 |
| **Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust** | | | |
| 4,706 % fällig am 25.02.2036 ^ | 11 | 10 | 0,00 |
| **Bear Stearns ALT-A Trust** | | | |
| 2,844 % fällig am 25.04.2035 | 233 | 233 | 0,01 |
| 4,294 % fällig am 25.09.2035 ^ | 22 | 19 | 0,00 |
| **BX Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 3,144 % fällig am 15.11.2035 | 4.142 | 4.149 | 0,17 |
| **BX Trust** | | | |
| 3,274 % fällig am 15.07.2034 | 594 | 595 | 0,03 |
| **Citigroup Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 3,244 % fällig am 15.07.2032 | 4.000 | 4.004 | 0,17 |
| 3,674 % fällig am 15.07.2027 | 3.000 | 3.001 | 0,12 |
| **Civic Mortgage LLC** | | | |
| 4,349 % fällig am 25.11.2022 | 1.414 | 1.413 | 0,06 |
| **CLNS Trust** | | | |
| 3,212 % fällig am 11.06.2032 | 3.000 | 3.004 | 0,13 |
| **Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 3,043 % fällig am 10.03.2046 | 1.737 | 1.733 | 0,07 |
| **Core Industrial Trust** | | | |
| 3,040 % fällig am 10.02.2034 | 1.897 | 1.942 | 0,08 |
| **Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.** | | | |
| 4,293 % fällig am 25.09.2034 | $ 296 | $ 297 | 0,01 |
| **Credit Suisse Mortgage Capital Trust** | | | |
| 3,144 % fällig am 15.07.2032 | 2.000 | 2.001 | 0,08 |
| **Great Wolf Trust** | | | |
| 3,244 % fällig am 15.09.2034 | 3.000 | 3.004 | 0,12 |
| **GS Mortgage Securities Corp. Trust** | | | |
| 3,094 % fällig am 15.07.2032 | 1.500 | 1.499 | 0,06 |
| **GS Mortgage Securities Trust** | | | |
| 3,648 % fällig am 10.01.2047 | 1.196 | 1.230 | 0,05 |
| **GSR Mortgage Loan Trust** | | | |
| 3,919 % fällig am 25.06.2034 | 111 | 111 | 0,01 |
| 4,470 % fällig am 25.11.2035 ^ | 281 | 267 | 0,01 |
| **Impac CMB Trust** | | | |
| 3,044 % fällig am 25.03.2035 | 217 | 216 | 0,01 |
| **JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 3,304 % fällig am 15.06.2035 | 2.300 | 2.303 | 0,10 |
| 3,394 % fällig am 15.06.2032 | 2.258 | 2.263 | 0,09 |
| **Merrill Lynch Mortgage Investors Trust** | | | |
| 4,044 % fällig am 25.03.2033 | 697 | 708 | 0,03 |
| 4,602 % fällig am 25.05.2033 | 488 | 498 | 0,02 |
| **Natixis Commercial Mortgage Securities Trust** | | | |
| 3,144 % fällig am 15.02.2033 | 1.000 | 994 | 0,04 |
| **RBSSP Resecuritization Trust** | | | |
| 4,759 % fällig am 25.10.2035 | 325 | 328 | 0,01 |
| **Sequoia Mortgage Trust** | | | |
| 3,063 % fällig am 20.10.2034 | 1.112 | 1.098 | 0,05 |
| **Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust** | | | |
| 4,403 % fällig am 25.03.2034 | 24 | 24 | 0,00 |
| **Structured Asset Mortgage Investments Trust** | | | |
| 3,050 % fällig am 19.10.2034 | 832 | 835 | 0,04 |
| **VMC Finance LLC** | | | |
| 3,314 % fällig am 15.10.2035 | 4.893 | 4.904 | 0,20 |
| **WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust** | | | |
| 2,674 % fällig am 25.12.2045 | 74 | 75 | 0,00 |
| 2,864 % fällig am 25.04.2045 | 4 | 4 | 0,00 |
| 3,993 % fällig am 25.10.2035 | 600 | 599 | 0,03 |
| **Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust** | | | |
| 4,986 % fällig am 25.01.2035 | 313 | 324 | 0,01 |
| 4,991 % fällig am 25.03.2036 | 54 | 56 | 0,00 |
| **Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust** | | | |
| 3,594 % fällig am 15.06.2045 | 5.500 | 5.555 | 0,23 |
| | | 65.990 | 2,73 |
| **US-REGIERUNGSBEHÖRDEN** | | | |
| **Fannie Mae** | | | |
| 2,836 % fällig am 25.11.2047 | 5.978 | 5.958 | 0,25 |
| **Fannie Mae UMBS** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.10.2047 | 30.651 | 31.573 | 1,31 |
| 4,000 % fällig am 01.07.2048 | 18.241 | 18.871 | 0,78 |
| **Freddie Mac** | | | |
| 1,854 % fällig am 15.01.2038 (a) | 1.736 | 114 | 0,00 |
| 2,750 % fällig am 22.05.2024 | 15.000 | 15.018 | 0,62 |
| 2,790 % fällig am 15.10.2037 - 15.02.2038 | 14.450 | 14.403 | 0,60 |
| 2,800 % fällig am 05.06.2024 | 4.500 | 4.501 | 0,19 |
| 2,836 % fällig am 15.06.2038 | 2.955 | 2.951 | 0,12 |
| 2,859 % fällig am 15.01.2038 | 1.736 | 1.728 | 0,07 |
| 3,904 % fällig am 25.07.2044 | 8 | 8 | 0,00 |
| 4,000 % fällig am 01.08.2048 | 13.547 | 14.041 | 0,58 |
| **Freddie Mac UMBS** | | | |
| 3,500 % fällig am 01.05.2049 | 42.280 | 43.240 | 1,79 |
| **Ginnie Mae** | | | |
| 2,927 % fällig am 20.02.2067 | 1.678 | 1.677 | 0,07 |
| 3,217 % fällig am 20.12.2065 - 20.08.2067 | 5.173 | 5.223 | 0,22 |
| 3,250 % fällig am 20.12.2068 | 2.021 | 2.000 | 0,08 |
| 3,267 % fällig am 20.01.2066 | 774 | 780 | 0,03 |
| 3,309 % fällig am 20.05.2066 | 681 | 687 | 0,03 |
| 3,359 % fällig am 20.11.2066 | 1.418 | 1.432 | 0,06 |
| 3,467 % fällig am 20.03.2066 | 923 | 937 | 0,04 |
| 3,629 % fällig am 20.04.2067 | 6.635 | 6.880 | 0,29 |
| 5,342 % fällig am 20.09.2066 | 2.508 | 2.754 | 0,11 |
| | | 174.776 | 7,24 |
| **US-SCHATZOBLIGATIONEN** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities (d)** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 (f) | 27.211 | 27.003 | 1,12 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| 0,125 % fällig am 15.07.2024 | $ 9.986 | $ 9.972 | 0,41 |
| 0,250 % fällig am 15.01.2025 (f) | 19.525 | 19.555 | 0,81 |
| 0,375 % fällig am 15.07.2025 | 6.271 | 6.342 | 0,26 |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 | 11.334 | 11.610 | 0,48 |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 (f) | 83.058 | 86.576 | 3,59 |
| | | 161.058 | 6,67 |
| Summe USA | | 1.451.472 | 60,15 |
| **KURZFRISTIGE INSTRUMENTE** | | | |
| **COMMERCIAL PAPER** | | | |
| **Encana Corp.** | | | |
| 3,200 % fällig am 01.08.2019 | 2.000 | 1.995 | 0,08 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 3,350 % fällig am 21.01.2020 | 500 | 491 | 0,02 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|---|
| **VW Credit, Inc.** | | | | |
| 3,050 % fällig am 01.07.2019 | $ | 5.300 | $ 5.299 | 0,22 |
| 3,050 % fällig am 02.07.2019 | | 2.000 | 2.000 | 0,09 |
| | | | 9.785 | 0,41 |
| **PENSIONSGESCHÄFTE (g)** | | | | |
| | | | 1.474 | 0,06 |
| **KURZFRISTIGE SCHULDTITEL** | | | | |
| **Pagares Portador Banco Central** | | | | |
| 2,504 % fällig am 24.07.2019 (b)(c) | CLP | 13.820.000 | 20.327 | 0,84 |
| Summe kurzfristige Instrumente | | | 31.586 | 1,31 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | MARKT-WERT (000S) | % DES NETTOVER-MÖGENS |
|---|---|---|---|
| **ZUR BARMITTELVERWALTUNG VERWENDETE ZENTRALE FONDS** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)** | 3.687.751 | $ 36.933 | 1,53 |
| **Summe Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente – Amtliche Börse/Geregelter Markt** | | **$ 2.463.650** | **102,10** |

**AN EINEM GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*, außer Anzahl der Kontrakte)**

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

**FUTURES**

| Beschreibung | Art | Ablaufmonat | Anzahl der Kontrakte | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| 3-Month Canada Bankers Acceptance December Futures | Long | 12/2020 | 1.322 | $ 316 | 0,01 |
| 3-Month Canada Bankers Acceptance September Futures | Long | 09/2020 | 880 | 728 | 0,03 |
| 3-Month Euribor March Futures | Long | 03/2022 | 2.626 | 2.585 | 0,11 |
| 90-Day Eurodollar June Futures | Short | 06/2020 | 5.694 | (2.552) | (0,10) |
| Canada Government 10-Year Bond September Futures | Long | 09/2019 | 287 | (141) | (0,01) |
| U.S. Treasury 2-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 851 | 780 | 0,03 |
| U.S. Treasury 5-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 523 | 191 | 0,01 |
| U.S. Treasury 10-Year Note September Futures | Long | 09/2019 | 210 | 579 | 0,02 |
| U.S. Treasury 10-Year Ultra September Futures | Long | 09/2019 | 304 | 883 | 0,04 |
| | | | | $ 3.369 | 0,14 |
| **Summe der an einem geregelten Markt gehandelten Finanzderivate** | | | | **$ 3.369** | **0,14** |

**ZENTRAL ABGERECHNETE FINANZDERIVATE (Angaben in Tausend*)**

*** Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter Tausend liegt**

**CREDIT DEFAULT SWAPS AUF KREDITINDIZES – SCHUTZKAUF[1]**

| Index/Tranchen | Zu bezahlender Festzinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag[2] | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|
| CDX.HY-31 5-Year Index | (5,000) % | 20.12.2023 | $ 17.169 | $ (1.080) | (0,05) |
| CDX.HY-32 5-Year Index | (5,000) | 20.06.2024 | 32.600 | (84) | 0,00 |
| CDX.IG-31 5-Year Index | (1,000) | 20.12.2023 | 92.600 | (414) | (0,02) |
| CDX.IG-32 5-Year Index | (1,000) | 20.06.2024 | 120.400 | (345) | (0,01) |
| | | | | $ (1.923) | (0,08) |

**ZINSSWAPS**

| Zahlung/ Erhalt variabler Zinssatz | Variabler Zinssatzindex | Fester Zinssatz | Fälligkeits-datum | Nennbetrag | Nicht realisierte Wertzunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Erhalt | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,300 % | 01.03.2022 | $ 1.219.300 | $ (27.406) | (1,14) |
| Zahlung[3] | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,336 | 18.03.2020 | 3.824.200 | 6.459 | 0,27 |
| Zahlung | 1-Day USD-Federal Funds Rate Compounded-OIS | 2,500 | 01.03.2020 | 1.136.500 | 4.755 | 0,20 |
| Zahlung | 3-Month CAD-Bank Bill | 2,300 | 16.07.2020 | CAD 426.400 | 2.452 | 0,10 |
| Zahlung | 3-Month USD-LIBOR | 2,386 | 21.06.2020 | $ 442.000 | (32) | 0,00 |
| Erhalt | 3-Month USD-LIBOR | 3,000 | 19.12.2028 | 138.300 | (8.465) | (0,35) |
| | | | | | $ (22.237) | (0,92) |
| **Summe der zentral abgerechneten Finanzderivate** | | | | | **$ (24.160)** | **(1,00)** |

(1) Agiert der Teilfonds als Käufer von Sicherheiten und es tritt ein Kreditereignis ein, das die Bedingungen des betreffenden Swaps definiert, dann erhält der Teilfonds entweder (i) vom Sicherungsgeber einen Betrag in Höhe des Nennwerts des Swaps und liefert die betreffende Verbindlichkeit oder das Basiswertpapier, das im betreffenden Index enthalten ist, oder (ii) er erhält einen Nettoabrechnungsbetrag in Form von Barmitteln, Wertpapieren oder anderen zu liefernden Obligationen, der dem Nennbetrag des Swaps entspricht, abzüglich des Rückerlangungswerts der betreffenden Verbindlichkeit oder des Basiswertpapiers, das im betreffenden Index enthalten ist.

(2) Der maximal mögliche Betrag, den der Teilfonds gemäß dem Swap als Verkäufer einer Kreditsicherheit zahlen muss oder den er als Käufer einer Kreditsicherheit erhalten kann, wenn ein Kreditereignis eintritt.

(3) Dieses Instrument tritt zu einem in der Zukunft liegenden Datum in Kraft.

# Aufstellung der Wertpapieranlagen des US 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 SWAPTIONS AUF KREDITINDIZES

| Kontrahent | Beschreibung | Schutzkauf/ -verkauf | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 % | 21.08.2019 | 11.300 | $ (13) | $ (2) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 15.000 | (14) | (4) | 0,00 |
| BPS | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 21.08.2019 | 27.300 | (25) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 49.000 | (68) | (12) | 0,00 |
| BRC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,000 | 18.09.2019 | 14.900 | (17) | (4) | 0,00 |
| CBK | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 21.08.2019 | 12.600 | (13) | (2) | 0,00 |
| DUB | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 11.100 | (12) | (3) | 0,00 |
| FBF | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 13.300 | (16) | (3) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 1,050 | 18.09.2019 | 5.500 | (6) | (1) | 0,00 |
| GST | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 22.800 | (23) | (4) | 0,00 |
| | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,950 | 18.09.2019 | 16.900 | (20) | (5) | 0,00 |
| MYC | Put - OTC CDX.IG-32 5-Year Index | Verkauf | 0,900 | 21.08.2019 | 11.200 | (11) | (2) | 0,00 |
| | | | | | | $ (238) | $ (46) | 0,00 |

### ZINSSWAPOPTIONEN

| Kontrahent | Beschreibung | Variabler Zinssatzindex | Zahlung/Erhalt variabler Zinssatz | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Marktwert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DUB | Call - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Erhalt | 1,710 % | 24.07.2019 | 299.600 | $ (608) | $ (371) | (0,02) |
| | Put - OTC 2-Year Interest Rate Swap | 3-Month USD-LIBOR | Zahlung | 1,710 | 24.07.2019 | 299.600 | (609) | (677) | (0,03) |
| | | | | | | | $ (1.217) | $ (1.048) | (0,05) |

### OPTIONEN AUF WERTPAPIERE

| Kontrahent | Beschreibung | Ausübungs-kurs | Verfalls-datum | Nennbetrag[1] | Aufgeld | Markt-wert | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FAR | Put - OTC Fannie Mae UMBS, TBA 3,000 % fällig am 01.09.2049 | $ 99,637 | 05.09.2019 | 118.500 | $ (331) | $ (293) | (0,01) |

(1) Der Nominalbetrag stellt die Anzahl der Kontrakte dar.

## DEVISENTERMINKONTRAKTE

| Kontrahent | Abrechnungs-monat | Zu zahlende Währung | | Zu erhaltende Währung | | Nicht realisierte Wertzunahme | Nicht realisierte (Wertabnahme) | Nicht realisierte Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | $ | 74.133 | AUD | 106.155 | $ 361 | $ 0 | $ 361 | 0,01 |
| | 08/2019 | AUD | 106.155 | $ | 74.211 | 0 | (365) | (365) | (0,02) |
| BPS | 07/2019 | | 34.583 | | 24.156 | 0 | (113) | (113) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 3.107 | € | 2.771 | 49 | 0 | 49 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 68.172 | £ | 53.748 | 233 | 0 | 233 | 0,01 |
| | 08/2019 | £ | 53.748 | $ | 68.276 | 0 | (236) | (236) | (0,01) |
| BSS | 07/2019 | CLP | 13.818.860 | | 20.187 | 0 | (174) | (174) | 0,00 |
| CBK | 07/2019 | AUD | 71.572 | | 49.548 | 0 | (678) | (678) | (0,03) |
| | 07/2019 | ¥ | 6.100 | | 56 | 0 | (1) | (1) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 2.053 | CAD | 2.769 | 66 | 0 | 66 | 0,00 |
| | 07/2019 | | 20.398 | CLP | 13.818.860 | 0 | (37) | (37) | 0,00 |
| | 07/2019 | | 86.549 | € | 76.154 | 175 | 0 | 175 | 0,01 |
| | 07/2019 | | 4.128 | £ | 3.256 | 16 | 0 | 16 | 0,00 |
| | 08/2019 | € | 76.154 | $ | 86.770 | 0 | (176) | (176) | (0,01) |
| | 09/2019 | CLP | 13.818.860 | | 20.398 | 31 | 0 | 31 | 0,00 |
| GLM | 07/2019 | € | 80.001 | | 89.279 | 0 | (1.825) | (1.825) | (0,08) |
| | 07/2019 | £ | 10.474 | | 13.292 | 0 | (38) | (38) | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 3.080 | | 158 | 1 | 0 | 1 | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 157 | MXN | 3.080 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| HUS | 07/2019 | € | 5.268 | $ | 5.990 | 0 | (10) | (10) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ | 97 | € | 86 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | MXN | 3.080 | $ | 157 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 10/2019 | $ | 157 | MXN | 3.080 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| JPM | 07/2019 | | 1.217 | € | 1.076 | 9 | 0 | 9 | 0,00 |
| RBC | 08/2019 | CAD | 4.831 | $ | 3.691 | 0 | (9) | (9) | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | £ | 43.274 | | 54.772 | 0 | (303) | (303) | (0,01) |
| UAG | 07/2019 | $ | 57 | ¥ | 6.100 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | ¥ | 6.100 | $ | 57 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | | | | | | $ 941 | $ (3.965) | $ (3.024) | (0,13) |

## ABGESICHERTE DEVISENTERMINKONTRAKTE

Zum 30. Juni 2019 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 Nettowert-zunahme/ (-abnahme) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BOA | 07/2019 | € 123.192 | $ 139.995 | $ 0 | $ (296) | $ (296) | (0,01) |
| | 08/2019 | $ 140.352 | € 123.192 | 297 | 0 | 297 | 0,01 |
| BRC | 07/2019 | 143.828 | 128.600 | 2.622 | 0 | 2.622 | 0,11 |
| CBK | 07/2019 | € 123.730 | $ 140.616 | 0 | (287) | (287) | (0,01) |
| | 07/2019 | $ 106 | € 93 | 0 | 0 | 0 | 0,00 |
| | 08/2019 | 140.365 | 123.192 | 285 | 0 | 285 | 0,01 |
| GLM | 07/2019 | 264 | 234 | 2 | 0 | 2 | 0,00 |
| MYI | 07/2019 | 140.121 | 125.309 | 2.581 | 0 | 2.581 | 0,10 |
| RBC | 07/2019 | € 1.783 | $ 2.022 | 0 | (8) | (8) | 0,00 |
| RYL | 07/2019 | 9.304 | 10.526 | 0 | (69) | (69) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 4.781 | € 4.228 | 34 | 0 | 34 | 0,00 |
| SCX | 07/2019 | € 6.478 | $ 7.308 | 1 | (70) | (69) | 0,00 |
| | 07/2019 | $ 1.494 | € 1.319 | 8 | 0 | 8 | 0,00 |
| SSB | 07/2019 | 141 | 126 | 3 | 0 | 3 | 0,00 |
| TOR | 07/2019 | 142.738 | 127.649 | 2.629 | 0 | 2.629 | 0,11 |
| | | | | $ 8.462 | $ (730) | $ 7.732 | 0,32 |

| | | |
|---|---|---|
| **Summe Freiverkehrsfinanzderivate** | **$ 3.321** | **0,13** |
| **Summe Anlagen** | **$ 2.446.180** | **101,37** |
| **Sonstige Aktiva und Passiva** | **$ (33.119)** | **(1,37)** |
| **Nettovermögen** | **$ 2.413.061** | **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.**

**^ Das Wertpapier ist in Verzug.**

**(a) Als Wertpapiere gehandelte Zinsscheine.**

**(b) Nullkuponwertpapier.**

**(c) Der Kupon stellt eine Rendite bis zur Endfälligkeit dar.**

**(d) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.**

**(e) Mit dem Fonds verbunden.**

**(f) Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 117.383 als Sicherheiten verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen und/oder globalen Rahmenverträgen für Pensionsgeschäfte wurden zum 30. Juni 2019 Wertpapiere mit einem Gesamtmarktwert von USD 578 als Sicherheiten erhalten.**

**Barmittel in Höhe von USD 17.412 wurden zum 30. Juni 2019 als Sicherheit für börsennotierte und zentral abgerechnete Finanzderivate verpfändet.**

**Gemäß den Rahmenverträgen der International Swaps and Derivatives Association, Inc. wurden zum 30. Juni 2019 Barmittel in Höhe von USD 3.560 als Sicherheiten für Finanzderivate verpfändet.**

**(g) Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kapital-betrag | Besichert durch | Sicherheiten (erhalten) | Pensions-geschäfte, zum Wert | Zu erhaltende Erlöse aus Pensions-geschäft[1] | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FICC | 2,000 % | 28.06.2019 | 01.07.2019 | $ 1.474 | U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2021 | $ (1.504) | $ 1.474 | $ 1.474 | 0,06 |
| **Summe Pensionsgeschäfte** | | | | | | **$ (1.504)** | **$ 1.474** | **$ 1.474** | **0,06** |

(1) Umfasst aufgelaufene Zinsen.

**Bewertung zum Marktwert[1]**

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 30. Juni 2019 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 76.905 | $ 2.384.748 | $ 1.997 | $ 2.463.650 |
| Finanzderivate[3] | 3.369 | (20.839) | 0 | (17.470) |
| **Summen** | **$ 80.274** | **$ 2.363.909** | **$ 1.997** | **$ 2.446.180** |

Es folgt eine Zusammenfassung der bei der marktgerechten Bewertung der Aktiva und Passiva des Teilfonds zum 31. Dezember 2018 verwendeten Inputfaktoren:

| Kategorie[2] | An aktiven Märkten notierte Kurse für identische Anlagen (Stufe 1) | Wesentliche sonstige beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 2) | Wesentliche nicht beobachtbare Inputfaktoren (Stufe 3) | Marktwert |
|---|---|---|---|---|
| Übertragbare Wertpapiere | $ 56.258 | $ 3.192.471 | $ 0 | $ 3.248.729 |
| Finanzderivate[3] | (11.366) | (790) | 0 | (12.156) |
| **Summen** | **$ 44.892** | **$ 3.191.681** | **$ 0** | **$ 3.236.573** |

(1) Zwecks zusätzlicher Informationen siehe Erläuterung 3 in den Erläuterungen zum Abschluss.

(2) Weitere Informationen finden Sie in der Aufstellung der Wertpapieranlagen.

(3) Finanzderivate können offene Terminkontrakte, Swap-, Verkaufs- oder Kaufoptionen sowie Devisenterminkontrakte enthalten.

**Umgekehrte Pensionsgeschäfte zum 30. Juni 2019:**

| Kontrahent | Kreditzins | Abrechnungs-datum | Fälligkeits-datum | Kreditbetrag | Verbindlichkeiten aus Pensions-geschäften | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|---|---|---|---|
| FOB | 2,650 % | 27.06.2019 | 26.07.2019 | $ (19.916) | $ (19.922) | (0,82) |
| RCY | 2,610 | 11.06.2019 | 23.07.2019 | (95.850) | (95.988) | (3,98) |
| **Summe Umgekehrte Pensionsgeschäfte** | | | | | **$ (115.910)** | **(4,80)** |

**Sicherheiten (erhalten)/verpfändet für OTC Finanzderivate**

Es folgt eine Zusammenfassung der Kontrahenten und des Marktwerts der OTC Finanzderivate und Sicherheiten (erhalten)/verpfändet zum 30. Juni 2019:

| Kontrahent | Gesamtmarktwert der OTC-Derivate | Sicherheiten (erhalten)/verpfändet | Netto-Engagement[1] |
|---|---|---|---|
| BOA | $ (9) | $ 0 | $ (9) |
| BPS | (83) | 0 | (83) |
| BRC | 2.618 | (2.720) | (102) |
| BSS | (174) | 0 | (174) |
| CBK | (608) | 310 | (298) |
| DUB | (1.051) | 430 | (621) |
| FAR | (293) | 0 | (293) |
| FBF | (4) | 0 | (4) |
| GLM | (1.860) | 1.770 | (90) |
| GST | (9) | 0 | (9) |
| HUS | (10) | 0 | (10) |
| JPM | 9 | 0 | 9 |
| MYC | (2) | 0 | (2) |
| MYI | 2.581 | (2.360) | 221 |
| RBC | (17) | 0 | (17) |
| RYL | (35) | (60) | (95) |
| SCX | (364) | 380 | 16 |
| SSB | 3 | 0 | 3 |
| TOR | 2.629 | (2.690) | (61) |

(1) Das Nettoengagement stellt die zu erhaltenden/(zahlenden) Beträge dar, die der Kontrahent bei Zahlungsverzug zu zahlen hätte bzw. die an ihn zu zahlen wären.

**Vergleichsinformationen**

Folgendes ist eine Zusammenfassung der Vergleichsinformationen für die Aufstellung der Wertpapieranlagen zum 30. Juni 2019:

| | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| An einer amtlichen Börse zugelassene übertragbare Wertpapiere | 60,37 | 82,72 |
| An einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere | 41,67 | 39,85 |
| Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 0,06 | 0,01 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | 0,14 | (0,43) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | (1,00) | (0,04) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | 0,13 | 0,01 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | (4,80) | (25,62) |

Das Anlageportfolio des Teilfonds konzentriert sich zum 30. Juni 2019 auf die folgenden Segmente:

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Australien | 0,49 | 1,18 |
| Bermuda | 0,37 | 0,04 |
| Kanada | 1,51 | 1,75 |
| Cayman-Inseln | 4,06 | 4,27 |
| Chile | 0,48 | 0,47 |
| China | 0,57 | 1,40 |
| Curacao | 0,02 | 0,02 |
| Dänemark | 0,15 | 0,14 |
| Finnland | 0,08 | 0,00 |
| Frankreich | 0,25 | 1,18 |
| Deutschland | 0,33 | 0,79 |

| Anlagen zum Marktwert | 30. Juni 2019 (%) | 31. Dez. 2018 (%) |
|---|---|---|
| Guernsey, Kanalinseln | 0,32 | 0,28 |
| Hongkong | 1,65 | 1,27 |
| Indien | 1,37 | 1,96 |
| Irland | 3,20 | 3,79 |
| Israel | 0,28 | 0,31 |
| Italien | 0,00 | 0,34 |
| Japan | 7,29 | 8,95 |
| Jersey, Kanalinseln | 0,00 | 0,04 |
| Luxemburg | 0,81 | 0,24 |
| Malaysia | 0,10 | 0,91 |
| Mexiko | 0,00 | 0,28 |
| Niederlande | 2,22 | 1,57 |
| Neuseeland | 0,11 | 0,15 |
| Norwegen | 0,16 | 0,14 |
| Katar | 0,37 | 0,35 |
| Singapur | 1,09 | 0,97 |
| Südkorea | 0,02 | 0,17 |
| Spanien | 0,33 | 0,31 |
| Schweden | 0,08 | 0,07 |
| Schweiz | 0,34 | 0,32 |
| Thailand | 0,13 | 0,16 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0,76 | 0,03 |
| Großbritannien | 10,17 | 5,98 |
| Vereinigte Staaten | 60,15 | 81,19 |
| Kurzfristige Instrumente | 1,31 | 0,93 |
| Zur Barmittelverwaltung verwendete zentrale Fonds | 1,53 | 0,63 |
| An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate | | |
| Futures | 0,14 | (0,43) |
| Zentral abgerechnete Finanzderivate | | |
| Credit Default Swaps auf Kreditindizes – Schutzkauf | (0,08) | 0,05 |
| Zinsswaps | (0,92) | (0,09) |
| Freiverkehrsfinanzderivate | | |
| Verkaufsoptionen | | |
| Credit Default Swaptions auf Kreditindizes | 0,00 | (0,02) |
| Zinsswapoption | (0,05) | 0,00 |
| Optionen auf Wertpapiere | (0,01) | 0,00 |
| Devisenterminkontrakte | (0,13) | (0,04) |
| Abgesicherte Devisenterminkontrakte | 0,32 | 0,07 |
| Sonstige Aktiva und Passiva | (1,37) | (22,12) |
| Nettovermögen | 100,00 | 100,00 |

# Erläuterungen zum Abschluss

## 1. ALLGEMEINE INFORMATIONEN

Die einzelnen in diesem Bericht beschriebenen Teilfonds (nachfolgend jeweils als ein „Teilfonds“ und gemeinsam als die „Teilfonds“ bezeichnet) sind Teilfonds der PIMCO Funds: Global Investors Series plc (die „Gesellschaft“), einer offenen Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und mit gesonderter Haftung zwischen den Teilfonds und mit beschränkter Haftung, die gemäß dem Companies Act von 2014 unter der Register-Nr. 276928 in Irland eingetragen und von der Zentralbank von Irland (die „Zentralbank“) nach den Rechtsvorschriften der Europäischen Gemeinschaften von 2011 (Organismen für die gemeinsame Anlage in übertragbaren Wertpapieren („OGAW“)) (Verordnung Nr. 352 von 2011) in der jeweils geltenden Fassung (die „OGAW-Richtlinien“) genehmigt wurde. Bei der Gesellschaft handelt es sich um eine Umbrella-Gesellschaft, die aus verschiedenen Teilfonds besteht, die jeweils eine oder mehrere Anteilsklassen umfassen. Nach dem Ermessen des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“ oder die „Verwaltungsratsmitglieder“) dürfen für einen Teilfonds mehrere Anteilsklassen („Klassen“) ausgegeben werden. Für jeden einzelnen Teilfonds wird ein gesondertes Vermögenswertportfolio geführt, welches in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik, die auf diesen Teilfonds zutreffen, angelegt wird. Der Verwaltungsrat darf mit vorheriger schriftlicher Zustimmung der Zentralbank zu gegebener Zeit zusätzliche Teilfonds auflegen. Der Verwaltungsrat darf gemäß den Anforderungen der Zentralbank zu gegebener Zeit Klassen Teilfonds auflegen. Die Gesellschaft wurde am 10. Dezember 1997 gegründet.

Wie im Verkaufsprospekt der Gesellschaft vorgesehen, wurden Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd und PIMCO Deutschland GmbH (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) als Anlageberatungsgesellschaften für verschiedene Teilfonds der Gesellschaft bestellt. PIMCO Asia Limited und PIMCO Asia Pte Ltd (jeweils eine „Anlageberatungsgesellschaft“) haben von der Zentralbank die Genehmigung erhalten, als Anlageberatungsgesellschaft für irische Fonds zu agieren.

Gemäß dem Verkaufsprospekt der Gesellschaft kann jede Anlageberatungsgesellschaft die diskretionäre Anlageverwaltung der Teilfonds vorbehaltlich aller gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen einer oder mehreren Unter-Anlageberatungsgesellschaften übertragen. Wenn für einen bestimmten Teilfonds eine Anlageberatungsgesellschaft bestellt wurde, hat die Anlageberatungsgesellschaft die jeweils übrigen Anlageberatungsgesellschaften als Unter-Anlageberatungsgesellschaft bezüglich des bzw. der jeweiligen Fonds bestellt. Die Gebühren der einzelnen entsprechend bestellten Unter-Anlageberatungsgesellschaften sind von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften im Namen der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr zu begleichen.

Parametric Portfolio Associates, LLC wurde damit beauftragt, Unterstützung bei der Umsetzung der Anlagepolitik des PIMCO RAE Emerging Markets Fund, des PIMCO RAE Europe Fund, des PIMCO RAE Global Developed Fund, des PIMCO RAE US Fund und des Strategic Income Fund zu bieten und verfügt über beschränkte Anlageentscheidungsbefugnis. In dieser Hinsicht verfügt Parametric Portfolio Associates, LLC über eine Ermessensbefugnis, für die bestimmte Parameter und Einschränkungen gelten, die zwischen der Anlageberatungsgesellschaft und Research Affiliates, LLC vereinbart wurden. Research Affiliates, LLC wurde zur Unter-Anlageberatungsgesellschaft mit Ermessensbefugnis bezüglich der oben erwähnten Fonds bestellt.

Parametric Portfolio Associates, LLC wurde zur Unter-Anlageberatungsgesellschaft mit Ermessensbefugnis in Bezug auf den PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund, den PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund, den PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund und den PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor US Equity Fund bestellt und verfügt über beschränkte Anlageentscheidungsbefugnis.

Research Affiliates, LLC wurde für den PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund, den PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund und den PIMCO RAE PLUS US Fund zur Unter-Anlageberatungsgesellschaft ohne Entscheidungsbefugnis bestellt. Die Anteile des PIMCO RAE PLUS US Funds wurden während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2019 vollständig zurückgenommen.

PIMCO Global Advisors (Ireland) Ltd. (die „Verwaltungsgesellschaft“) ist die Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft.

## 2. WICHTIGE BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Die bei der Erstellung dieses Abschlusses verwendeten wesentlichen Rechnungslegungs- und Schätzungsmethoden sind mit denen konform, die die Gesellschaft für den geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018 (der „geprüfte Jahresabschluss“) verwendet hat. Der Abschluss wird für alle Teilfonds, mit Ausnahme des PIMCO RAE PLUS US Fund, dessen Anteile im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 vollständig zurückgenommen wurden, auf der Basis der Unternehmensfortführung erstellt.

### Erstellungsgrundlage

Bei dem vorliegenden Abschluss handelt es sich um den ungeprüften verkürzten Abschluss für den Sechsmonatszeitraum zum 30. Juni 2019. Er wurde gemäß Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Zwischenberichterstattung“, wie vom Financial Reporting Council („FRC“) veröffentlicht, und die OGAW-Richtlinien.

Der ungeprüfte verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem geprüften Jahresabschluss, der von den Abschlussprüfern einen uneingeschränkten Bestätigungsvermerk erhalten hat und der im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen (FRS 102), dem Irischen Statut, bestehend aus dem Companies Act (Gesetz über Aktiengesellschaften) von 2014 und den OGAW-Richtlinien erstellt wurde, gelesen werden. Bei den in Irland allgemein für die Erstellung von Rechnungsabschlüssen anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen handelt es sich um diejenigen, die vom FRC herausgegeben werden.

Die in der Aufstellung der ausgewiesenen Gesamtgewinne und -verluste sowie in einer Überleitung der Eigenkapitalveränderungen aufzuführenden Angaben sind nach Auffassung des Verwaltungsrats in der Betriebsergebnisrechnung sowie im Ausweis der Nettovermögensänderungen enthalten.

Die Gesellschaft hat von der Ausnahme keine Kapitalflussrechnung zu erstellen Gebrauch gemacht, die offenen Investmentfonds nach FRS 102 zur Verfügung steht.

Dieser Abschluss wurde nach der Anschaffungskostenregelung unter Zugrundelegung der Neubewertung der ergebniswirksam zum Marktwert bewerteten Finanzvermögen und -verbindlichkeiten aufgestellt.

Die Zahlen im Abschluss wurden auf Tausend gerundet, es sei denn, im Bericht werden anders lautende Angaben gemacht.

## 3. ANLAGEN ZUM MARKTWERT

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 — Der nicht bereinigte, an einem aktiven Markt quotierte Preis für identische Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, auf den die Gesellschaft zum Bewertungsstichtag zugreifen kann.
- Stufe 2 — Inputparameter, bei denen es sich nicht um die der Stufe 1 zugeordneten quotierten Preise handelt, die für einen Vermögenswert oder eine Verbindlichkeit entweder direkt oder indirekt beobachtbar (d. h. anhand von Marktdaten hergeleitet) sind.
- Stufe 3 — Nicht beobachtbare Inputfaktoren (d. h. für die keine Marktdaten verfügbar sind) für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit.

Eine Analyse der zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der einzelnen Teilfonds zum 30. Juni 2019 und zum 31. Dezember 2018 ist der Aufstellung der Wertpapieranlagen zu entnehmen. Die von den Fonds zur Klassifizierung von zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten anhand einer Zeitwerthierarchie verwendete Methode ist mit derjenigen konform, die im geprüften Jahresabschluss angewandt wurde.

## 4. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Innerhalb der durch die Anlageziele und Anlagepolitik der Teilfonds und nach Maßgabe der von der Zentralbank jeweils festgesetzten Grenzen und des laut Prospektbestimmungen erlaubten Umfangs sind die Finanzderivate und Anlagetechniken von allen Teilfonds für eine effiziente Portfolioverwaltung einzusetzen. Die Teilfonds können diese Finanzderivate und Anlagetechniken zur Absicherung gegen Zinsänderungen, Devisenkursänderungen in anderen Währungen als der Funktionswährung, gegen Änderungen in Wertpapierkursen oder als Teil ihrer allgemeinen Anlagestrategie einsetzen.

Der durch die Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt USD 46.086.672/ (USD 541.444) (30. Juni 2018: USD 17.365.610/(USD 1.140.152)).

Der durch die umgekehrten Pensionsgeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt USD 1.615.423/(USD 139.516.420) (30. Juni 2018: USD 813.165/(USD 74.629.665)).

Der durch die Sale-BuybackGeschäfte im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 entstandene Zinsertrag/(-aufwand) betrug insgesamt USD 100.243/(USD 4.624.024) (30. Juni 2018: USD 217.793/(USD 8.686.391).

## 5. DIVIDENDENAUSSCHÜTTUNGSPOLITIK

Wie in der jeweiligen Teilfondsergänzung 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 Teilfonds dennoch Dividenden aus den Nettokapitalerträgen und/oder Kapital bezahlen.
(iii) Andere Mittel (einschließlich Kapital), die nach dem Gesetz aus dem betreffenden Teilfonds bzw. der betreffenden Anteilsklasse des betreffenden Teilfonds ausgeschüttet werden können.

Verwaltungsgebühren und andere Gebühren oder ein Teil davon können dem Kapital belastet werden. Das kann dazu führen, dass das Kapital sinkt und Erträge mit einem verminderten Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erwirtschaftet werden. Dieser Zyklus kann sich solange fortsetzen, bis das Kapital aufgezehrt ist. Der Grund für die Belastung des Kapitals ist, den an die Anleger ausschüttbaren Betrag zu maximieren.

Für die Anteilsklasse ausschüttend II (wodurch höhere Renditen für Anteilinhaber erzielt werden sollen) 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 in Erwägung zu ziehen (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 Emerging Asia 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 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 Teilfonds 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 Teilfonds 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 Teilfonds wurde ein Teil der Dividendenausschüttungen gemäß der Betriebsergebnisrechnung aus dem Kapital gezahlt (Angaben in Tausend):

| Fonds | Am 30. Jun. 2019 abgeschlossener Berichtszeitraum | Am 30. Jun. 2018 abgeschlossener Berichtszeitraum |
|---|---|---|
| Euro Income Bond Fund | € 673 | € 431 |
| Global Multi-Asset Fund | 0 | $ 854 |

## 6. SOFT COMMISSIONS

Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann Transaktionen im Namen der Teilfonds über oder mit Unterstützung von Ausführungsmaklern durchführen, die zusätzlich zur routinemäßigen Order-Ausführung gelegentlich Güter, Dienstleistungen oder andere Vorteile wie etwa Research- und Beratungsdienste für die Gesellschaft oder ihre Beauftragten bereitstellen oder beschaffen können. Die Gesellschaft bzw. ihre Anlageberatungsgesellschaft kann diesen Brokern Full-Service-Provisionssätze zahlen, die teilweise für die Bereitstellung zulässiger Güter oder Dienstleistungen verwendet werden können. Diejenigen Anlageberatungsgesellschaften, bei denen es sich um MiFID-Investmentgesellschaften handelt, müssen Research-Leistungen Dritter, die sie im Zusammenhang mit der Verwaltung des Vermögens der einzelnen Teilfonds kaufen, direkt aus ihren eigenen Mitteln bezahlen.

## 7. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft des Umbrella-Typs mit variablem Kapital und Haftungstrennung zwischen ihren Teilfonds. Dementsprechend sind etwaige Verbindlichkeiten, die im Namen eines Teilfonds der Gesellschaft entstanden oder diesem zuzuordnen sind, ausschließlich aus den Vermögenswerten des betreffenden Teilfonds zu begleichen, und weder die Gesellschaft noch ein Verwaltungsratsmitglied, Konkursverwalter, Revisor, Insolvenzverwalter, kommissarischer Insolvenzverwalter oder eine sonstige Personen dürfen die Vermögenswerte dieses Teilfonds zum Ausgleich von Verbindlichkeiten im Namen eines anderen Teilfonds der Gesellschaft verwenden oder sind verpflichtet, sie hierzu zu verwenden, unabhängig davon, wann diese Verbindlichkeit entstanden ist.

## 8. 10. ÄNDERUNGEN AM PROSPEKT, AN DER GRÜNDUNGSUKRUNDE UND DER SATZUNG

Der Verkaufsprospekt der Gesellschaft wurde aktualisiert und am 1. Oktober 2018 von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

Am 20. März 2019 wurden Ergänzungen zum konsolidierten Verkaufsprospekt geändert, um die Möglichkeit für Anlagen am China Inter-Bank Bond Market durch den Dynamic Multi-Asset Fund, den Emerging Asia Bond Fund, den Emerging Local Bond Fund, den Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund, den Global Advantage Fund, den Global Bond ESG Fund, den Global Bond Ex-US Fund, den Global Bond Fund, den Global Multi-Asset Fund, den Income Fund, den Low Duration Income Fund und den Strategic Income Fund sowie die damit verbundenen Risikohinweise zu berücksichtigen.

## 9. GEBÜHREN UND KOSTEN

### (a) An die Verwaltungsgesellschaft zu zahlende Gebühren

Die an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlenden Gebühren sind im Verkaufsprospekt aufgeführt und dürfen 2,50 % per annum des NIWs des jeweiligen Teilfonds nicht übersteigen.

### (b) Verwaltungsgebühr

Die Verwaltungsgesellschaft erbringt oder liefert für jeden Teilfonds, wie im Verkaufsprospekt beschrieben, Anlageberatungs-, Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste, für die jeder Teilfonds eine einzige Verwaltungsgebühr an die Verwaltungsgesellschaft zahlt. Die Verwaltungsgebühr (wie im Verkaufsprospekt definiert) für jeden Teilfonds läuft an jedem Handelstag (wie in der Ergänzung für den jeweiligen Teilfonds definiert) auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft kann die Verwaltungsgebühr vollständig oder teilweise an die Anlageberatungsgesellschaften entrichten, um die von diesen erbrachten Anlageberatungs- und anderen Dienste zu bezahlen und damit die Anlageberatungsgesellschaften die Kosten für die Administrations-, Verwahr- und anderen Dienste begleichen können, die die Verwaltungsgesellschaft für die Teilfonds erbracht hat.

Die Verwaltungsgebühr für die einzelnen Klassen der einzelnen Teilfonds (angegeben in Prozent pro Jahr ihres NIW) lautet wie folgt:

| | Anteilsklassen Inst'l, G Inst'l, Inv, Admin (%) | H Inst'l (%) | Class E, G Retail, M Retail, T (%) | Class R (%) |
|---|---|---|---|---|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | 0,65 | k. A. | 1,55 | k. A. |
| PIMCO Capital Securities Fund | 0,79 | k. A. | 1,69 | 0,93 |
| Commodity Real Return Fund | 0,74 | k. A. | 1,64 | k. A. |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 0,90 | k. A. | 1,80 | k. A. |
| Diversified Income Fund | 0,69 | 0,86 | 1,59 | 0,87 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 0,69 | k. A. | 1,59 | 0,87 |
| Dynamic Bond Fund | 0,90 | 1,07 | 1,80 | 0,99 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | 0,85[1] | k. A. | 1,85 | k. A. |
| Emerging Asia Bond Fund | k. A. | k. A. | 1,50 | k. A. |
| Emerging Local Bond Fund | 0,89 | k. A. | 1,89 | k. A. |
| Emerging Markets Bond Fund | 0,79 | 0,96 | 1,69 | k. A. |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 0,95 | k. A. | 1,85 | k. A. |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund[2] | 0,85 | k. A. | k. A. | k. A. |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 0,85 | k. A. | 1,75 | k. A. |
| Euro Bond Fund | 0,46 | k. A. | 1,36 | k. A. |
| Euro Credit Fund[3] | 0,46 | 0,63 | 1,36 | k. A. |
| Euro Income Bond Fund | 0,49 | k. A. | 1,39 | k. A. |
| Euro Long Average Duration Fund | 0,46 | k. A. | k. A. | k. A. |
| Euro Low Duration Fund | 0,46 | k. A. | 1,36 | k. A. |
| Euro Short-Term Fund | 0,40 | k. A. | 1,15 | k. A. |
| Global Advantage Fund | 0,70 | k. A. | 1,70 | k. A. |
| Global Advantage Real Return Fund | 0,69 | k. A. | 1,59 | k. A. |
| Global Bond Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 |
| Global Bond ESG Fund | 0,52 | k. A. | 1,42 | k. A. |
| Global Bond Ex-US Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | k. A. |
| Global High Yield Bond Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | 0,52 | k. A. | k. A. | k. A. |
| Global Libor Plus Bond Fund | 0,49 | k. A. | 1,20 | k. A. |
| Global Low Duration Real Return Fund | 0,49 | k. A. | 1,39 | k. A. |
| Global Multi-Asset Fund | 0,95 | k. A. | 2,15 | k. A. |
| Global Real Return Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | 0,76 |
| Income Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 |
| Inflation Strategy Fund | 0,90 | k. A. | 2,10 | k. A. |
| Low Average Duration Fund | 0,46 | 0,63 | 1,36 | 0,75 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 0,49 | k. A. | 1,39 | k. A. |
| Low Duration Income Fund[4] | 0,55 | k. A. | 1,30 | k. A. |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 0,99[5] | k. A. | 2,20 | 1,21 |
| Mortgage Opportunities Fund | 0,69 | k. A. | 1,59 | k. A. |
| PIMCO RAE Emerging Markets Fund[6] | 0,75 | k. A. | 1,60 | 0,88 |
| PIMCO RAE Europe Fund[7] | 0,45 | k. A. | 1,30 | 0,72 |
| PIMCO RAE Global Developed Fund[8] | 0,50 | k. A. | 1,35 | k. A. |
| PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | 1,15 | k. A. | 2,50 | k. A. |
| PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | 0,95 | k. A. | 2,25 | k. A. |
| PIMCO RAE PLUS US Fund | 0,85 | k. A. | 2,15 | k. A. |
| PIMCO RAE US Fund[7] | 0,40 | k. A. | 1,25 | 0,69 |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund | 0,49 | k. A. | k. A. | k. A. |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund | 0,39 | k. A. | k. A. | k. A. |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund | 0,39 | k. A. | k. A. | k. A. |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund | 0,29 | k. A. | k. A. | k. A. |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 0,89 | k. A. | 1,74 | k. A. |
| StocksPLUS™ Fund | 0,55 | k. A. | 1,45 | k. A. |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 0,69 | k. A. | 1,59 | k. A. |
| Strategic Income Fund | 0,85[9] | k. A. | 1,75 | k. A. |
| Total Return Bond Fund | 0,50 | 0,67 | 1,40 | 0,77 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund[10] | 1,25 | k. A. | 2,35 | k. A. |
| UK Corporate Bond Fund[11] | 0,46 | k. A. | k. A. | 0,75 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 0,46 | k. A. | k. A. | k. A. |
| US High Yield Bond Fund | 0,55 | 0,72 | 1,45 | 0,80 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 0,49 | 0,66 | 1,39 | k. A. |
| US Short-Term Fund[12] | 0,45 | 0,62 | 0,85 | k. A. |

(1) Bei allen Klassen (mit Ausnahme der Class E, G Retail, M Retail, Class R und Class T) wurde vom 1. Januar 2018 bis zum 31. Dezember 2018 ein Gebührenverzicht in Höhe von 0,05 % p.a. angewandt. Der Gebührenverzicht endete am 1. Januar 2019. Bei dem in der Tabelle angegebenen Wert ist der Gebührenverzicht nicht berücksichtigt.

(2) Bei allen Klassen (mit Ausnahme der Class R, Class E, M Retail und T Retail) wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,10 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht läuft am 1. April 2021 ab, und die Ergänzung wird bei der nächstmöglichen Gelegenheit nach Ablauf des Gebührenverzichts aktualisiert.

(3) In den Gebühren der Institutional Class wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,08 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht läuft zum 1. Juli 2019 ab. Bei dem in der Tabelle angegebenen Wert ist der Gebührenverzicht nicht berücksichtigt.

(4) Bei allen Klassen (mit Ausnahme der Class E, G Retail und Class T) wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,05 % p.a. für die Zeit ab Auflegung bis zum 31. Dezember 2020 berücksichtigt. Der Gebührenverzicht endet am 1. Januar 2021.

(5) Bis zum 30. Juni 2018 wurde vom Manager für die Institutional Class ein Gebührenverzicht in Höhe von 0,15 % p.a. gewährt. Bei dem in der Tabelle angegebenen Wert ist der Gebührenverzicht nicht berücksichtigt.

(6) Bei allen Klassen (mit Ausnahme der Class R) wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,20 % p.a. berücksichtigt. Für die Class R wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,11 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht endet am 1. November 2019.

(7) Bei allen Klassen (mit Ausnahme der Class R) wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,10 % p.a. berücksichtigt. Für die Class R wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,05 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichte verlängern sich bis zum 31. Oktober 2019. Der Gebührenverzicht endet am 1. November 2019.

(8) Bei allen Klassen (mit Ausnahme der Class R) wird bei dieser Zahl ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,10 % p.a. berücksichtigt. Für die Class R wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,06 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichte verlängern sich bis zum 31. Oktober 2019. Der Gebührenverzicht endet am 1. November 2019.

(9) Bis zum 31. Dezember 2018 wurde vom Manager für alle Klassen ein Gebührenverzicht in Höhe von 0,05 % gewährt. Der Gebührenverzicht endete am 1. Januar 2019. Bei dem in der Tabelle angegebenen Wert ist der Gebührenverzicht nicht berücksichtigt.

(10) Diese Zahl berücksichtigt für alle Klassen einen Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,15 % p.a. vom 1. August 2018 bis zum 31. Juli 2020 (0,25 % p.a. bis zum 31. Juli 2018). Der Gebührenverzicht endet am 1. August 2020.

(11) In den Gebühren der Institutional Class wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,07 % p.a. berücksichtigt. Der Gebührenverzicht wird zum 1. Juli 2019 auf 0,05 % p.a. gesenkt.

(12) In den Gebühren für die Anteilsklassen Class E, G Retail und M Retail wird ein Gebührenverzicht des Managers in Höhe von 0,30 % p.a. berücksichtigt. Die Gebührenverzichte verlängern sich bis zu dem Zeitpunkt, zu dem der Manager durch vorherige schriftliche Mitteilung an die Anteilinhaber des Teilfonds entscheidet, diesen Gebührenverzicht künftig nicht mehr anzuwenden oder zu reduzieren.

Die Verwaltungsgebührensätze waren für alle Teilfonds gegenüber dem 31. Dezember 2018 unverändert, mit Ausnahme des Ablaufs der Gebührenverzichte für den Strategic Income Fund.

Der PIMCO RAE PLUS US Fund wurde abgewickelt. Er hat keine Anleger mehr und weitere Zeichnungen für den Teilfonds sind nicht mehr möglich.

Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund, der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund und der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund wurden während des Berichtszeitraums aufgelegt.

Die Verwaltungsgebühr für die Anteilsklassen H Institutional, Class E, G Retail, M Retail und Class T fällt allgemein höher aus als die Verwaltungsgebühr für die anderen Anteilsklassen. Aus dieser höheren Gebühr kann die Verwaltungsgesellschaft die Kosten für Vertriebs-, Mittler- oder andere Dienste begleichen, die Vertriebsstellen, Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder andere Intermediäre den Anteilinhabern dieser Anteilsklassen der Teilfonds direkt oder indirekt erbringen. Da es sich bei der Verwaltungsgebühr um einen festen Betrag handelt, wird das Risiko von Preiserhöhungen bei den Kosten für durch die Verwaltungsgebühr abgedeckte Dienste von der Verwaltungsgesellschaft und nicht von den Anteilinhabern getragen. Die Verwaltungsgesellschaft trägt darüber hinaus das Risiko, dass das Ausgabenniveau für diese Dienste aufgrund eines sinkenden Nettovermögens die Höhe der Verwaltungsgebühr übersteigt. Auf der anderen Seite würde die Verwaltungsgesellschaft, und nicht die Anteilinhaber, von allen Preissenken bei den Kosten für die Dienste profitieren, die die Verwaltungsgebühr abdeckt. Dazu zählen gesunkene Ausgabenniveaus, in Prozent vom Nettovermögen, aufgrund steigenden Nettovermögens.

Aufgrund der Art der Emission von Class Z wird in der Betriebsergebnisrechnung keine Verwaltungsgebühr ausgewiesen (die Class Z werden primär für andere Teilfonds der Gesellschaft oder für Direktanlagen durch institutionelle Anleger angeboten, die mit den Anlageberatungsgesellschaften oder einem verbundenen Unternehmen von PIMCO eine Anlageverwaltungsvereinbarung oder sonstige Vereinbarung abgeschlossen haben). Um doppelte Gebühren zu vermeiden, wird die Verwaltungsgebühr für die Class Z auf 0,00 % pro Jahr festgesetzt.

**(c) Anlageberatungsdienste**

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Anlageberatungsdienstleistungen. Zu diesen Dienstleistungen gehören die Anlage und Wiederanlage der Vermögenswerte jedes Teilfonds. Die Gebühren der Anlageberatungsgesellschaften (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr beglichen.

**(d) Administrations-, Verwahr- sowie sonstige Dienste**

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft Administrations-, Verwahr- und sonstige Dienste. Diese Dienste beinhalten Administrations-, Übertragungsstellen-, Fondsbuchhaltungs-, Verwahr- und Unterdepotdienste für die einzelnen Teilfonds. Die Gebühren und Aufwendungen des Administrators und der Verwahrstelle (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr bzw. Von den Anlageberatungsgesellschaften gezahlt.

Im Namen der Gesellschaft erbringt bzw. veranlasst die Verwaltungsgesellschaft bestimmte sonstige Dienste. Diese können enthalten: Dienste der Notierungs- und Zahlstellen- sowie sonstige Vertretungsdienste vor Ort, Buchhaltungs-, Prüf-, Rechts- sowie sonstige Dienste qualifizierter Berater, Gesellschaftssekretärsdienste, Druck-, Veröffentlichungs- und Übersetzungsdienste sowie die Erbringung und Koordination bestimmter Aufsichts-, Administrations- und Anteilinhaberdienste, die für den Betrieb der Teilfonds erforderlich sind. Gebühren und ordentliche Aufwendungen für diese Dienste (zuzüglich gegebenenfalls hierauf anfallender MwSt.) werden von der Verwaltungsgesellschaft oder von den Anlageberatungsgesellschaften für die Verwaltungsgesellschaft aus der Verwaltungsgebühr gezahlt.

Die Teilfonds übernehmen sonstige Aufwendungen im Zusammenhang mit ihrem Betrieb, die nicht von der Verwaltungsgebühr abgedeckt werden und die variieren und die Gesamthöhe der Aufwendungen der Teilfonds beeinflussen können. Hierzu zählen unter anderem Steuern und staatliche Abgaben, Maklergebühren, Provisionen und sonstige Transaktionskosten, Fremdfinanzierungskosten einschließlich Zinsaufwand, Gründungskosten, außerordentliche Aufwendungen (wie Prozesskosten und Schadenersatzleistungen) sowie die Gebühren und Aufwendungen der unabhängigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sowie ihrer Berater.

Die Gesellschaft bezahlte den Verwaltungsratsmitgliedern während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2019 Honorare in Höhe von € 90.000 (30. Juni 2018: € 116.500). Darüber hinaus werden jedem unabhängigen Verwaltungsratsmitglied alle angemessenen Auslagen erstattet. Die Verwaltungsratshonorare sind in den „Sonstigen Aufwendungen“ der Betriebsergebnisrechnung enthalten.

**Servicegebühr** Die Servicegebühr, die ausschließlich für die Investor Classes anfällt, ist an die Verwaltungsgesellschaft zu zahlen und darf verwendet werden, um Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu vergüten, die Dienste im Zusammenhang mit dem Vertrieb und der Vermarktung von Anteilen erbringen und/oder für die Erbringung bestimmter Anteilinhaberdienstleistungen oder für die Verwaltung von Plänen oder Programmen, die Teilfondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, und um sonstige verbundene Aufwendungen zu erstatten. Die Verwaltungsgesellschaft erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Anteilinhaber der Investor Classes. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten identische Dienstleistungen für die erhobenen Gebühren. Diese Dienste können beinhalten: die Beantwortung von Anteilinhaberanfragen zu den Teilfonds und ihrer Wertentwicklung, die Unterstützung von Anteilinhabern beim Erwerb, der Rücknahme und dem Tausch von Anteilen, die Führung von individueller Kontoinformationen und die Bereitstellung von Kontoauszügen an die Anteilinhaber sowie die Führung sonstiger Unterlagen, die für die Anlage der Anteilinhaber im Teilfonds relevant sind.

Pläne oder Programme, die Teilfondsanteile als Finanzierungsmittel verwenden, können fondsgebundene Versicherungsprodukte sowie Pensions-, Altersversorgungs- oder Sparpläne von Arbeitgebern beinhalten. Alle Anteilinhaber der Investor Classes erhalten Dienstleistungen entsprechend der Vereinbarungen mit den Finanzintermediären, mit denen die Anteilinhaber ein Dienstleistungsverhältnis unterhalten. Die Servicegebühr errechnet sich jährlich aus 0,35 % des NIW des jeweiligen Teilfonds, der auf die Investor Classes entfällt. Die Servicegebühr hat sich von 2018 auf 2019 nicht geändert. Die Servicegebühr wird aus dem NIW gezahlt, der auf den NIW der Investor Classes dieser Teilfonds entfällt. Die Servicegebühr für die einzelnen Teilfonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Verwaltungsgesellschaft darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Servicegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

**Bestandspflegegebühr** Die Bestandspflegegebühr für Administrative-Anteilsklassen ist zahlbar an die Vertriebsstelle für persönliche Dienstleistungen, die sie den Anteilinhabern der Teilfonds erbringt, und für die Führung der Anteilinhaberkonten, einschließlich der Vergütung und der Aufwendungen (einschließlich Telefonkosten und Gemeinkosten) von Finanzberatern und sonstigen Mitarbeitern beteiligter oder involvierter Händler, bestimmter Banken oder anderer Finanzintermediäre, die bei der Abwicklung von Kauf- oder Rücknahmeanträgen oder der Abwicklung von Dividendenzahlungen unterstützend tätig sind, den Anteilinhabern regelmäßig Informationen über ihre Beteiligung an den Teilfondsanteilen liefern, Informationen von der Gesellschaft an die Anteilinhaber weitergeben, laufende Beratungsleistungen in Bezug auf die Eignung bestimmter vom Teilfonds angebotener Anlagemöglichkeiten vor dem Hintergrund der Anteilinhaberanforderungen erbringen, Anfragen der Anteilinhaber zu diesen Diensten beantworten oder Mitarbeiter für die Erbringung derartiger Dienste schulen.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Administrative-Anteilsklassen. Die Bestandspflegegebühr wird auf Basis eines prozentualen Anteils des Nettoinventarwerts des jeweiligen Teilfonds berechnet und den jeweiligen Anteilsklassen der betreffenden Teilfonds wie im Verkaufsprospekt angegeben zugewiesen. Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Teilfonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich rückwirkend zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Bestandspflegegebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

Die Bestandspflegegebühr für die einzelnen Teilfonds (dargestellt in Prozent des NIW) beläuft sich mit Ausnahme des StocksPLUS™ Fund auf 0,50 % p.a. des auf die Administrative Classes entfallenden NIW. Die Bestandspflegegebühr für den StocksPLUS™ Fund (dargestellt in Prozent des NIW) beläuft sich 0,75 % p.a. des auf die Administrative Classes entfallenden NIW.

Die Bestandspflegegebühr hat sich von 2018 auf 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 Teilfonds erbracht hat.

Die Vertriebsstelle erbringt diese Dienste direkt oder indirekt über Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre für alle Inhaber von Anteilsklassen der T Class.

Die Vertriebsgebühr errechnet sich jährlich aus 0,40 % des NIW des jeweiligen Teilfonds, der auf die Anteilsklassen der Class T entfällt, außer in Bezug auf den PIMCO 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, den PIMCO RAE PLUS US Fund (bis zum Datum der Abwicklung) und den Total Return Bond Fund. Für diese Teilfonds wird eine Vertriebsgebühr von 0,30 % p.a. auf den NIW dieser Teilfonds bezahlt, der auf die Anteilsklassen der Class T entfällt.

Die Vertriebsgebühr für die einzelnen Teilfonds läuft an jedem Handelstag auf und ist monatlich im Nachhinein zahlbar. Die Vertriebsstelle darf zu ihrer eigenen Verwendung etwaige Vertriebsgebühren ganz oder teilweise einbehalten, die nicht an Wertpapierhändler, Banken, Finanzintermediäre oder sonstige Intermediäre zu zahlen sind.

**(f) Ausgabenbegrenzung (einschließlich Verzicht auf und Nachzahlung von 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 Teilfonds für alle Klassen des Teilfonds zu verwalten, wobei sie auf ihre Verwaltungsgebühr ganz oder teilweise verzichtet bzw. diese ganz oder teilweise reduziert oder erstattet, falls (und für den Zeitraum, in dem) diese Betriebskosten aufgrund gezahlter Gründungskosten sowie anteiliger Verwaltungsratshonorare die Summe aus der Verwaltungsgebühr der Klasse dieses Teilfonds (vor Anrechnung eines etwa anwendbaren Verzichts auf die Verwaltungsgebühr) aus etwa anfallenden Service- und Bestandspflegegebühren sowie aus sonstigen von dieser Teilfondsklasse zu tragenden Kosten, die die oben beschriebene Verwaltungsgebühr nicht abdeckt, (ausgenommen Gründungskosten und anteilige Verwaltungsratshonorare) zzgl. 0,0049 % pro Jahr (täglich auf Basis des Teilfonds-NIW berechnet) überschreiten.

In jedem Monat, in dem der Verwaltungsvertrag gilt, darf die Verwaltungsgesellschaft von einem Teilfonds einen beliebigen Anteil der Verwaltungsgebühr wiedererlangen, auf die sie verzichtet, die sie reduziert oder erstattet hat, und dies gemäß dem Verwaltungsvertrag (der „Erstattungsbetrag“) während der vorangegangenen 36 Monate, vorausgesetzt dieser an die Verwaltungsgesellschaft gezahlte Betrag erfüllt folgende Bedingungen: 1) er darf pro Jahr 0,0049 % vom durchschnittlichen (täglich berechneten) Nettovermögen der Klasse des betreffenden Teilfonds nicht überschreiten; 2) er liegt nicht über dem Gesamterstattungsbetrag; 3) enthält keine der Verwaltungsgesellschaft zuvor erstatteten Beträge; bzw. 4) führt nicht dazu, dass eine Klasse eines Teilfonds einen negativen Ertrag behält.

Die in der Betriebsergebnisrechnung angegebene Verwaltungsgebühr wird vor Berücksichtigung des jeweils gegebenenfalls gewährten Verzichts auf Verwaltungsgebühren angegeben. Die Verzichte auf Verwaltungsgebühren werden in der Betriebsergebnisrechnung unter Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen. Die Verwaltungsgebühr wird der Verwaltungsgesellschaft nach Berücksichtigung des Verzichts gezahlt.

## 10. TRANSAKTIONEN ZWISCHEN VERBUNDENEN PARTEIEN

Bei der Verwaltungsgesellschaft, den Anlageberatungsgesellschaften, den Vertriebsstellen und den Verwaltungsratsmitgliedern handelt es sich um verbundene Parteien. An diese Parteien gegebenenfalls zahlbare Gebühren werden in Erläuterung 9 offengelegt.

Zum 30. Juni 2019 hielt die Verwaltungsgesellschaft 1.770.242 (31. Dezember 2018: 2.963.457) Anteile des US Short-Term Fund.

Bestimmte Teilfonds halten Umbrellafonds-interne Überkreuzinvestitionen in Class Z-Anteilen anderer Teilfonds der Gesellschaft. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Class Z und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Class Z dieser Teilfonds 0,00 % pro Jahr.

Die folgenden Teilfonds hielten zum 30. Juni 2019 Umbrellafonds-interne Überkreuzinvestitionen. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Teilfonds der Gesellschaft eliminiert.

| | 30. Juni 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 | US Short-Term Fund |
| Global Bond ESG Fund | Global Investment Grade Credit ESG 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 |
| Global Multi-Asset Fund | Global Advantage Real Return Fund |
| Global Multi-Asset Fund | Income 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 |

Die folgenden Teilfonds hielten zum 31. Dezember 2018 Umbrellafonds-interne Überkreuzinvestitionen. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft im vergleichenden Finanzstatus der Teilfonds eliminiert.

| | 31. Dezember 2018 |
|---|---|
| Fonds | Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds |
| Diversified Income Fund | US Short-Term Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | US Short-Term Fund |
| Dynamic Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Income Fund |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Mortgage Opportunities Fund |
| Global Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Global Multi-Asset Fund | Global Advantage Real Return Fund |
| Global Multi-Asset Fund | Income Fund |
| Low Average Duration Fund | US Short-Term Fund |
| Total Return Bond Fund | US Short-Term Fund |
| US High Yield Bond Fund | US Short-Term Fund |

Die folgenden Teilfonds hielten zum 30. Juni 2018 Umbrellafonds-interne Überkreuzinvestitionen. Diese Anlagen wurden zum Zweck der Darstellung der Summe der Gesellschaft in der vergleichenden Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen der Teilfonds eliminiert.

| | 30. Juni 2018 |
|---|---|
| Fonds | Überkreuzinvestitionen innerhalb des Umbrella-Fonds |
| Diversified Income Fund | US Short-Term Fund |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | US Short-Term Fund |
| Dynamic Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Income Fund |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Mortgage Opportunities Fund |
| Global Bond Fund | US Short-Term Fund |
| Global Multi-Asset Fund | Global Advantage Real Return Fund |
| Global Multi-Asset Fund | Income Fund |
| Low Average Duration Fund | US Short-Term Fund |
| Total Return Bond Fund | US Short-Term Fund |
| US High Yield Bond Fund | US Short-Term Fund |

Bestimmte Teilfonds investieren in die Class Z des PIMCO China Bond Fund und des PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, die als mit der Gesellschaft verbunden gelten. Aufgrund der Ausgestaltung des Angebots der Class Z und um doppelte Gebühren zu vermeiden, beträgt die Verwaltungsgebühr für die Class Z beider Teilfonds 0,00 % pro Jahr.

Bestimmte Teilfonds investieren in den PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF Fund, den PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF Fund und den PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF Fund, und diese gelten als mit der Gesellschaft verbunden. Da diese Teilfonds keine gebührenfreien Anteilsklassen haben, wird die Verwaltungsgebühr vom Dachfonds und dem verbundenen Zielfonds bezahlt. Ein Verzicht auf die Anlageberatungsgebühr wird daher vor der Zahlung durch den Teilfonds an den Manager ausgeglichen, was in der Betriebsergebnisrechnung innerhalb der Erstattungen der Anlageberatungsgesellschaft ausgewiesen wird.

Während der Berichtszeiträume zum 30. Juni 2019 und zum 30. Juni 2018 kauften und verkauften die unten erwähnten Teilfonds Wertpapiere verbundener Teilfonds, sie nahmen Käufe und Verkäufe in Bezug auf Überkreuzinvestitionen und Käufe und Verkäufe in verbundenen Teilfonds vor (Angaben in Tausend):

| | 30. Juni 2019 | |
|---|---|---|
| **Fonds** | **Käufe** | **Verkäufe** |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | $ 15.040 | $ 9.750 |
| PIMCO Capital Securities Fund | 725.468 | 433.131 |
| Commodity Real Return Fund | 0 | 247 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 1.982 | 6.611 |
| Diversified Income Fund | 361.434 | 100.178 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 32.098 | 66.870 |
| Dynamic Bond Fund | 350.988 | 201.420 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | 174.492 | 149.733 |
| Emerging Asia Bond Fund | 5.404 | 5.330 |
| Emerging Local Bond Fund | 1.037.852 | 1.204.527 |
| Emerging Markets Bond Fund | 1.164.168 | 1.095.280 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 54.032 | 57.783 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 12.815 | 3.845 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 40.352 | 14.733 |
| Euro Bond Fund | 142.196 | 51.678 |
| Euro Credit Fund | 319.056 | 160.753 |
| Euro Income Bond Fund | 415.307 | 141.008 |
| Euro Long Average Duration Fund | 54.617 | 37.400 |
| Euro Low Duration Fund | 42.253 | 44.867 |
| Euro Short-Term Fund | 17.937 | 4.452 |
| Global Advantage Fund | 137.572 | 126.882 |
| Global Advantage Real Return Fund | 25.006 | 25.253 |
| Global Bond Fund | 2.951.716 | 2.297.116 |
| Global Bond ESG Fund | 24.929 | 9.550 |
| Global Bond Ex-US Fund | 149.555 | 151.873 |
| Global High Yield Bond Fund | 104.017 | 83.050 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 3.069.138 | 3.295.003 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | 4.181 | 0 |
| Global Libor Plus Bond Fund | 109.768 | 99.392 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 218.696 | 241.866 |
| Global Multi-Asset Fund | 187.769 | 266.805 |
| Global Real Return Fund | 369.830 | 377.186 |
| Income Fund | 14.143.514 | 13.265.642 |
| Inflation Strategy Fund | 24.205 | 17.943 |
| Low Average Duration Fund | 21.302 | 71.631 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 80.347 | 75.877 |
| Low Duration Income Fund | 6.131 | 14.417 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 6.361 | 4.200 |
| Mortgage Opportunities Fund | 642.260 | 602.183 |
| PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | 0 | 8.911 |
| PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | 0 | 39.490 |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 210.992 | 233.119 |
| StocksPLUS™ Fund | 47.115 | 20.574 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 887 | 385 |
| Strategic Income Fund | 217.440 | 142.875 |
| Total Return Bond Fund | 209.319 | 379.262 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 3.337 | 5.450 |
| UK Corporate Bond Fund | 39.553 | 53.612 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 79.970 | 47.797 |
| US High Yield Bond Fund | 17.031 | 10.845 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 47.153 | 21.278 |
| US Short-Term Fund | 700.937 | 958.682 |

| | 30. Juni 2018 | |
|---|---|---|
| **Fonds** | **Käufe** | **Verkäufe** |
| PIMCO Capital Securities Fund | $ 772.428 | $ 950.687 |
| Commodity Real Return Fund | 4.518 | 605 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 110.449 | 134.237 |
| Diversified Income Fund | 300.206 | 358.452 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 142.167 | 67.294 |
| Dynamic Bond Fund | 249.175 | 250.222 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | 55.629 | 41.839 |
| Emerging Asia Bond Fund | 193 | 202 |
| Emerging Local Bond Fund | 914.274 | 776.271 |
| Emerging Markets Bond Fund | 1.261.762 | 1.576.688 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 75.244 | 93.416 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 13.605 | 543 |
| Euro Bond Fund | 76.954 | 45.597 |
| Euro Credit Fund | 121.431 | 238.417 |
| Euro Income Bond Fund | 212.640 | 91.643 |
| Euro Long Average Duration Fund | 31.664 | 31.065 |
| Euro Low Duration Fund | 17.076 | 57.005 |
| Euro Short-Term Fund | 44.460 | 133.205 |
| Global Advantage Fund | 133.776 | 171.326 |
| Global Advantage Real Return Fund | 25.828 | 23.202 |
| Global Bond Fund | 3.328.164 | 2.912.747 |
| Global Bond ESG Fund | 4.158 | 0 |
| Global Bond Ex-US Fund | 167.227 | 168.464 |
| Global High Yield Bond Fund | 1.207.282 | 1.478.743 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 4.632.617 | 4.913.170 |
| Global Libor Plus Bond Fund | 66.565 | 52.267 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 433.483 | 425.282 |
| Global Multi-Asset Fund | 340.589 | 349.695 |
| Global Real Return Fund | 495.417 | 361.490 |
| Income Fund | 12.996.741 | 13.947.049 |
| Inflation Strategy Fund | 28.540 | 27.700 |
| Low Average Duration Fund | 238.088 | 219.621 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 154.022 | 145.799 |
| Low Duration Income Fund | 5.046 | 0 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 17.764 | 29.200 |
| PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | 528 | 2.312 |
| PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | 0 | 26.588 |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 242.851 | 199.003 |
| StocksPLUS™ Fund | 76.243 | 4.213 |
| Total Return Bond Fund | 898.235 | 693.700 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 2.814 | 3.800 |
| UK Corporate Bond Fund | 15.095 | 57.597 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 116.677 | 62.725 |
| US High Yield Bond Fund | 109.024 | 33.792 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 16.745 | 17.291 |
| US Short-Term Fund | 685.259 | 675.760 |

In der folgenden Tabelle sind die umlaufenden Anteile aufgeführt, die zum 30. Juni 2019 und zum 31. Dezember 2018 von der Allianz Group als verbundene Parteien der Gesellschaft gehalten wurden und jeweils mehr als 20 % der Gesamtanteile eines Teilfonds ausmachen.

| **Fonds** | **30. Juni 2019 % Gehalten** | **31. Dez. 2018 % Gehalten** |
|---|---|---|
| Diversified Income Fund | k. A. | 22,46 |
| Emerging Local Bond Fund | 40,58 | 37,06 |
| Emerging Markets Bond Fund | 42,74 | 49,26 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 99,57 | k. A. |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 20,49 | 24,33 |
| Global Advantage Real Return Fund | 27,76 | 29,13 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 44,31 | 45,99 |
| Global Multi-Asset Fund | 22,68 | 24,82 |

| Fonds | 30. Juni 2019 % Gehalten | 31. Dez. 2018 % Gehalten |
|---|---|---|
| Inflation Strategy Fund | k. A. | 42,96 |
| PIMCO RAE Emerging Markets Fund | 36,09 | k. A. |
| PIMCO RAE Europe Fund | 46,46 | 39,90 |
| PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | 23,37 | k. A. |
| PIMCO RAE US Fund | 92,41 | 91,88 |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund | 100,00 | 100,00 |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund | 100,00 | 100,00 |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund | 100,00 | 100,00 |
| PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund | 100,00 | 100,00 |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 32,31 | 24,00 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 100,00 | k. A. |
| Strategic Income Fund | 47,00 | 51,82 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 22,27 | k. A. |
| Total Return Bond Fund | k. A. | 21,41 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 27,25 | 37,19 |

**Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs an Anteilen und Verträgen**

Zum 30. Juni 2019 hielt V. Mangala Ananthanarayanan 8.757,87 (31. Dezember 2018: 8.757,87) Anteile des Dynamic Multi-Asset Fund, 7.635,82 (31. Dezember 2018: 7.502,53) Anteile des Global Investment Grade Credit Fund und 19.946,52 (31. Dezember 2018: 19.557,68) Anteile des Income Fund, wobei es sich jeweils um Teilfonds der Gesellschaft handelt.

Zum 30. Juni 2019 hielt David M. Kennedy 5.507,00 (31. Dezember 2018: 5.677,32) Anteile des Emerging Markets Bond Fund und 16.786,79 (31. Dezember 2018: 16.786,79) Anteile des Global Multi-Asset Fund. Beide sind Teilfonds der Gesellschaft.

Während der zum 30. Juni 2019 und 30. Juni 2018 endenden Berichtszeiträume hielt kein anderes Verwaltungsratsmitglied eine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

Während der zum 30. Juni 2019 und 30. Juni 2018 endenden Berichtszeiträume hielt der Sekretär keine Beteiligung an Anteilen der Gesellschaft.

## 11. TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Transaktionen, die mit der Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle eines OGAW, den Beauftragten oder Unterbeauftragten einer solchen Verwaltungsgesellschaft oder Verwahrstelle (unter Ausschluss von konzernfremden, von einer Verwahrstelle bestellten Unterverwahrstellen) oder angeschlossenen Unternehmen oder Konzerngesellschaften einer solchen Verwaltungsgesellschaft, Verwahrstelle oder von entsprechenden Beauftragten oder Unterbeauftragten („verbundene Personen") durchgeführt werden, müssen so durchgeführt werden, als wären sie 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 Berichtszeitraums eingehalten wurden.

## 12. WECHSELKURSE

Um einen gemeinsamen Abschluss für die Teilfonds und Finanzdaten für die Gesellschaft zu erhalten (was nach irischem Gesellschaftsrecht erforderlich ist), wurden die Beträge im Finanzstatus zu dem am 30. Juni 2019 geltenden Wechselkurs von Euro in USD (USD/EUR 0,87812) (31. Dezember 2018: USD/EUR 0,87478) und von Pfund Sterling in USD (USD/GBP 0,78573) (31. Dezember 2018: USD/GBP 0,78518) umgerechnet. Die Beträge in der Betriebsergebnisrechnung und im Ausweis der Nettovermögensänderungen wurden zu einem durchschnittlichen Wechselkurs während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2019 von Euro in USD (USD/EUR 0,88542) (Berichtszeitraum zum 30. Juni 2018: USD/EUR 0,82683) und von GBP in USD (USD/GBP 0,77303) (Berichtszeitraum zum 30. Juni 2018: USD/GBP 0,72721) umgerechnet.

Die folgende Tabelle gibt die am 30. Juni 2019 und am 31. Dezember 2018 für die Umrechnung der Anlagen und sonstigen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die auf von der Funktionswährung des jeweiligen Teilfonds abweichende Währungen lauten, in Pfund Sterling, Euro und US-Dollar, die Funktionswährungen von Teilfonds der Gesellschaft, verwendeten Wechselkurse wieder:

| | 30. Juni 2019 Präsentationswährung | | |
|---|---|---|---|
| Fremdwährung | EUR | GBP | USD |
| AED | k. A. | k. A. | 3,67315 |
| ARS | 48,26578 | k. A. | 42,38300 |
| AUD | 1,62280 | 1,81361 | 1,42501 |
| BRL | 4,36462 | k. A. | 3,83265 |
| CAD | 1,48813 | 1,66310 | 1,30675 |
| CHF | 1,11033 | k. A. | 0,97500 |
| CLP | k. A. | k. A. | 678,95000 |
| CNH | 7,82698 | 8,74727 | 6,87300 |
| CNY | 7,82162 | k. A. | 6,86830 |
| COP | 3.652,13292 | k. A. | 3.207,00000 |
| CZK | 25,44405 | k. A. | 22,34285 |
| DKK | 7,46370 | 8,34128 | 6,55400 |
| DOP | k. A. | k. A. | 50,32000 |
| EGP | k. A. | k. A. | 16,69500 |
| EUR (oder €) | 1,00000 | 1,11758 | 0,87812 |
| GBP (oder £) | 0,89479 | 1,00000 | 0,78573 |
| HKD | 8,89688 | k. A. | 7,81250 |
| HUF | 322,77515 | k. A. | 283,43435 |
| IDR | 16.088,40280 | k. A. | 14.127,50000 |
| ILS | k. A. | k. A. | 3,56655 |
| INR | 78,60855 | k. A. | 69,02750 |
| JPY (oder ¥) | 122,69436 | 137,12072 | 107,74000 |
| KRW | 1.314,91589 | k. A. | 1.154,65000 |
| KZT | k. A. | k. A. | 380,62500 |
| MXN | 21,87823 | k. A. | 19,21165 |
| MYR | k. A. | k. A. | 4,13250 |
| NGN | k. A. | k. A. | 360,00000 |
| NOK | 9,70947 | 10,85111 | 8,52605 |
| NZD | 1,69553 | 1,89489 | 1,48887 |
| PEN | k. A. | k. A. | 3,28795 |
| PHP | k. A. | k. A. | 51,23500 |
| PLN | 4,24681 | k. A. | 3,72920 |
| RON | k. A. | k. A. | 4,15380 |
| RUB | 71,82984 | k. A. | 63,07500 |
| SEK | 10,56602 | k. A. | 9,27820 |
| SGD | 1,54074 | 1,72190 | 1,35295 |
| THB | k. A. | k. A. | 30,66750 |
| TRY | 6,58682 | 7,36130 | 5,78400 |
| TWD | 35,37057 | k. A. | 31,05950 |
| UAH | k. A. | k. A. | 26,15500 |
| USD (oder $) | 1,13880 | 1,27270 | 1,00000 |
| UYU | k. A. | k. A. | 35,23000 |
| VND | k. A. | k. A. | 23.305,00000 |
| ZAR | 16,05851 | k. A. | 14,10125 |

| | 31. Dez. 2018 Präsentationswährung | | |
|---|---|---|---|
| Fremdwährung | EUR | GBP | USD |
| AED | k. A. | k. A. | 3,67315 |
| ARS | 43,05102 | k. A. | 37,66000 |
| AUD | 1,62379 | 1,80909 | 1,42046 |
| BRL | 4,43056 | k. A. | 3,87575 |
| CAD | 1,56131 | 1,73948 | 1,36580 |
| CHF | 1,12692 | k. A. | 0,98580 |
| CLP | k. A. | k. A. | 694,00000 |
| CNH | 7,85384 | 8,75008 | 6,87035 |
| CNY | 7,84852 | k. A. | 6,86570 |
| COP | 3.712,37894 | k. A. | 3.247,50000 |
| CZK | 25,73699 | k. A. | 22,51410 |
| DKK | 7,46242 | 8,31400 | 6,52795 |

| Fremdwährung | 31. Dez. 2018 Präsentationswährung EUR | GBP | USD |
|---|---|---|---|
| EGP | k. A. | k. A. | 17,92000 |
| EUR (oder €) | 1,0000 | 1,11411 | 0,87478 |
| GBP (oder £) | 0,89758 | 1,00000 | 0,78518 |
| HKD | 8,95012 | k. A. | 7,82935 |
| HUF | 320,79995 | k. A. | 280,62810 |
| IDR | 16.438,49397 | k. A. | 14.380,00000 |
| ILS | k. A. | k. A. | 3,73675 |
| INR | k. A. | k. A. | 69,81500 |
| JPY (oder ¥) | 125,42068 | 139,73300 | 109,71500 |
| KRW | 1.275,52653 | k. A. | 1.115,80000 |
| MXN | 22,51291 | 25,08196 | 19,69375 |
| MYR | k. A. | k. A. | 4,13250 |
| NGN | 415,53495 | k. A. | 363,50000 |
| NOK | 9,89871 | 11,02829 | 8,65915 |
| NZD | 1,70479 | 1,89934 | 1,49131 |
| PEN | k. A. | k. A. | 3,37850 |
| PHP | k. A. | k. A. | 52,58500 |
| PLN | 4,29453 | k. A. | 3,75675 |
| RON | k. A. | k. A. | 4,07210 |
| RUB | 79,30316 | k. A. | 69,37250 |
| SEK | 10,13499 | k. A. | 8,86585 |
| SGD | 1,55811 | 1,73592 | 1,36300 |
| THB | k. A. | k. A. | 32,56000 |
| TRY | 6,08144 | 6,77542 | 5,31990 |
| TWD | 35,13700 | k. A. | 30,73700 |
| USD (oder $) | 1,14314 | 1,27359 | 1,0000 |
| UYU | k. A. | k. A. | 32,41500 |
| VND | k. A. | k. A. | 23.195,00000 |
| ZAR | 16,44421 | k. A. | 14,38500 |

## 13. FINANZIELLE RISIKEN

Durch ihre Aktivitäten sind die Teilfonds verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt, z. B. dem Marktrisiko (einschließlich Preisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), dem Kreditrisiko und dem Liquiditätsrisiko. Der allgemeine Risikomanagementprozess für die Teilfonds konzentriert sich auf die Unvorhersehbarkeit der Finanzmärkte und versucht, potenziell nachteilige Effekte auf die finanzielle Entwicklung der Teilfonds zu minimieren.

Die Zielsetzungen und Richtlinien des Finanzrisikomanagements der Gesellschaft entsprechen auch weiterhin denjenigen, die im geprüften Jahresabschluss der Gesellschaft für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2018 angegeben sind.

## 14. GRUNDKAPITAL

### (a) Genehmigte Anteile

Das genehmigte Grundkapital der Gesellschaft beträgt 38.092 € und ist in 30.000 Zeichneranteile zu je 1,27 € und 50.000.000.000 Aktien ohne Nennwert aufgeteilt, die zu Beginn als "nicht klassifizierte Investmentanteile" bezeichnet werden.

### (b) Zeichneranteile

Bis auf sieben sind die ursprünglichen 30.000 Zeichneranteile zurückgenommen worden. Die Zeichneranteile sind nicht Bestandteil des NIW der Gesellschaft und werden daher im Abschluss nur in Form dieser Erläuterung erwähnt. Nach Ansicht des Verwaltungsrates geben diese Offenlegungen die Art des Geschäftes der Gesellschaft als Investmentfonds wieder.

### (c) Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile

Das ausgegebene gewinnberechtigte Grundkapital entspricht jederzeit dem NIW der Teilfonds. Rückgabe- und gewinnberechtigte Anteile werden auf Antrag des Anteilinhabers zurückgenommen und sind als Finanzverbindlichkeiten klassifiziert.

## 15. NETTOINVENTARWERTE

Im Folgenden sind das rückgabe- und gewinnberechtigten Anteilinhabern zuzuschreibende Nettovermögen der einzelnen Teilfonds, die ausgegebenen und umlaufenden Anteile und der Nettoinventarwert je Anteil der vergangenen drei Berichtszeiträume (Angaben in Tausend, ausgenommen Beträge je Anteil) aufgeführt. Das Nettovermögen geteilt durch die Anzahl der ausgegebenen und umlaufenden Anteile kann vom NIW aufgrund gerundeter Werte abweichen:

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO Asia High Yield Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 141.210 | k. A. | k. A. |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 11.984 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.134 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,57 | k. A. | k. A. |
| Erträge | $ 5.655 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 546 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,36 | k. A. | k. A. |
| Administrative: | | | |
| Erträge | $ 11 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,36 | k. A. | k. A. |
| Class E: | | | |
| Erträge | $ 164 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,36 | k. A. | k. A. |
| Class E HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 82 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | HKD 10,31 | k. A. | k. A. |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 357 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 35 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 10,33 | k. A. | k. A. |
| M Retail: | | | |
| ausschüttend II | $ 11 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,30 | k. A. | k. A. |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | |
| ausschüttend II | HKD 82 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | HKD 10,25 | k. A. | k. A. |
| M Retail SGD (Hedged): | | | |
| ausschüttend II | SGD 14 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 10,27 | k. A. | k. A. |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 123.091 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.615 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,60 | k. A. | k. A. |
| **PIMCO Capital Securities Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 6.857.999 | $ 5.998.728 | $ 8.731.253 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 1.091.721 | $ 760.598 | $ 1.431.662 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 58.915 | 45.113 | 81.156 |
| NIW je Anteil | $ 18,53 | $ 16,86 | $ 17,64 |
| Erträge | $ 378.444 | $ 252.882 | $ 343.253 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 35.566 | 25.594 | 31.990 |
| NIW je Anteil | $ 10,64 | $ 9,88 | $ 10,73 |
| Institutional BRL (Hedged): | | | |
| thesaurierend | $ 6.531 | $ 6.591 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 698 | 792 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,36 | $ 8,32 | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 37.217 | CHF 36.107 | CHF 89.004 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.414 | 2.531 | 5.773 |
| NIW je Anteil | CHF 15,41 | CHF 14,27 | CHF 15,42 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | PIMCO Capital Securities Fund (Forts.) | | |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 1.791.755 | € 1.597.374 | € 2.215.360 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 130.347 | 125.726 | 161.980 |
| NIW je Anteil | € 13,75 | € 12,70 | € 13,68 |
| Erträge | € 430.268 | € 385.130 | € 421.390 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 35.966 | 34.128 | 33.412 |
| NIW je Anteil | € 11,96 | € 11,28 | € 12,61 |
| ausschüttend II | € 58.885 | € 56.089 | € 75.209 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.304 | 6.342 | 7.548 |
| NIW je Anteil | € 9,34 | € 8,84 | € 9,96 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 32.314 | £ 43.130 | £ 42.723 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.324 | 3.374 | 3.139 |
| NIW je Anteil | £ 13,90 | £ 12,78 | £ 13,61 |
| Erträge | £ 111.574 | £ 83.117 | £ 364.210 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.960 | 7.114 | 28.196 |
| NIW je Anteil | £ 12,45 | £ 11,68 | £ 12,92 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| ausschüttend II | k. A. | SGD 732 | SGD 1.089 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 76 | 103 |
| NIW je Anteil | k. A. | SGD 9,62 | SGD 10,62 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 244.850 | $ 257.096 | $ 253.944 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.198 | 22.117 | 20.805 |
| NIW je Anteil | $ 12,75 | $ 11,62 | $ 12,21 |
| Erträge | $ 175.712 | $ 156.485 | $ 186.250 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.597 | 15.919 | 17.448 |
| NIW je Anteil | $ 10,59 | $ 9,83 | $ 10,67 |
| Investor AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 14.484 | AUD 4.979 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.428 | 526 | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 10,14 | AUD 9,47 | k. A. |
| Investor CAD (Hedged): | | | |
| Erträge | CAD 494 | CAD 322 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 48 | 34 | k. A. |
| NIW je Anteil | CAD 10,27 | CAD 9,59 | k. A. |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 25.983 | € 28.302 | € 27.155 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.148 | 2.527 | 2.244 |
| NIW je Anteil | € 12,10 | € 11,20 | € 12,10 |
| Investor RMB (Hedged): | | | |
| Erträge | CNH 67.158 | CNH 1.580 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 643 | 16 | k. A. |
| NIW je Anteil | CNH 104,45 | CNH 97,03 | k. A. |
| Investor SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 2.269 | SGD 583 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 224 | 62 | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 10,13 | SGD 9,44 | k. A. |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 180.661 | $ 152.194 | $ 214.268 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.074 | 9.304 | 12.456 |
| NIW je Anteil | $ 17,93 | $ 16,36 | $ 17,20 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | PIMCO Capital Securities Fund (Forts.) | | |
| Erträge | $ 130.584 | $ 124.914 | $ 181.676 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.130 | 9.405 | 12.598 |
| NIW je Anteil | $ 14,30 | $ 13,28 | $ 14,42 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 29.000 | € 30.343 | € 46.152 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.766 | 1.994 | 2.804 |
| NIW je Anteil | € 16,42 | € 15,22 | € 16,46 |
| Administrative SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | SEK 3.757 | SEK 3.556 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 36 | 31 |
| NIW je Anteil | k. A. | SEK 104,89 | SEK 113,74 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 342.720 | $ 325.061 | $ 382.594 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25.652 | 26.622 | 29.675 |
| NIW je Anteil | $ 13,36 | $ 12,21 | $ 12,89 |
| Erträge | $ 97.925 | $ 90.552 | $ 104.130 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.241 | 9.203 | 9.747 |
| NIW je Anteil | $ 10,60 | $ 9,84 | $ 10,68 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 10.933 | CHF 10.407 | CHF 15.294 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 997 | 1.021 | 1.376 |
| NIW je Anteil | CHF 10,97 | CHF 10,20 | CHF 11,12 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 550.937 | € 567.201 | € 579.684 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 44.788 | 49.665 | 46.731 |
| NIW je Anteil | € 12,30 | € 11,42 | € 12,40 |
| Erträge | € 84.941 | € 79.820 | € 61.794 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.626 | 8.593 | 5.954 |
| NIW je Anteil | € 9,85 | € 9,29 | € 10,38 |
| M Retail: | | | |
| ausschüttend II | $ 251.602 | $ 251.307 | $ 537.623 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25.105 | 26.804 | 51.882 |
| NIW je Anteil | $ 10,02 | $ 9,38 | $ 10,36 |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 33.086 | HKD 32.309 | HKD 172.357 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.268 | 3.433 | 16.877 |
| NIW je Anteil | HKD 10,12 | HKD 9,41 | HKD 10,21 |
| M Retail SGD (Hedged): | | | |
| ausschüttend II | SGD 49.239 | SGD 48.913 | SGD 51.645 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.929 | 5.214 | 4.943 |
| NIW je Anteil | SGD 9,99 | SGD 9,38 | SGD 10,45 |
| Class R: | | | |
| Erträge | $ 5.985 | $ 6.552 | $ 10.474 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 560 | 660 | 971 |
| NIW je Anteil | $ 10,70 | $ 9,93 | $ 10,79 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | € 20.444 | € 17.987 | € 18.031 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.131 | 1.988 | 1.783 |
| NIW je Anteil | € 9,59 | € 9,05 | € 10,11 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 6.712 | £ 6.677 | £ 9.497 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 674 | 715 | 920 |
| NIW je Anteil | £ 9,95 | £ 9,34 | £ 10,33 |
| Class T: | | | |
| Erträge | $ 7.895 | $ 6.944 | $ 11.523 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 723 | 685 | 1.047 |
| NIW je Anteil | $ 10,92 | $ 10,14 | $ 11,01 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 65.892 | € 51.176 | € 43.841 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.838 | 4.874 | 3.829 |
| NIW je Anteil | € 11,29 | € 10,50 | € 11,45 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)** | | | |
| Class Z: | | | |
| Erträge | $ 97.203 | $ 83.952 | $ 121.268 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.304 | 7.724 | 10.273 |
| NIW je Anteil | $ 11,71 | $ 10,87 | $ 11,80 |
| Class Z AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 85.391 | AUD 64.756 | AUD 37.737 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.972 | 6.480 | 3.466 |
| NIW je Anteil | AUD 10,71 | AUD 9,99 | AUD 10,89 |
| **Commodity Real Return Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 537.614 | $ 521.092 | $ 518.533 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 404.414 | $ 368.377 | $ 336.611 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 64.210 | 62.875 | 49.850 |
| NIW je Anteil | $ 6,30 | $ 5,86 | $ 6,75 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 1.659 | € 4.766 | € 18.983 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 252 | 767 | 2.578 |
| NIW je Anteil | € 6,57 | € 6,22 | € 7,36 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 10.656 | £ 9.336 | £ 8.070 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.173 | 1.092 | 805 |
| NIW je Anteil | £ 9,08 | £ 8,55 | £ 10,02 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 13.184 | $ 20.609 | $ 17.440 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.399 | 4.024 | 2.944 |
| NIW je Anteil | $ 5,50 | $ 5,12 | $ 5,92 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 75.196 | $ 86.485 | $ 99.205 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.470 | 17.811 | 17.568 |
| NIW je Anteil | $ 5,20 | $ 4,86 | $ 5,65 |
| Erträge | $ 2.171 | $ 1.863 | $ 2.265 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 601 | 552 | 577 |
| NIW je Anteil | $ 3,61 | $ 3,38 | $ 3,93 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 23.776 | € 23.034 | € 24.400 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.579 | 4.672 | 4.138 |
| NIW je Anteil | € 5,19 | € 4,93 | € 5,90 |
| G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | € 108 | € 78 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12 | 9 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,12 | € 8,62 | k. A. |
| **PIMCO Credit Opportunities Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 147.060 | $ 141.586 | $ 288.667 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 44.215 | $ 38.089 | $ 46.235 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.338 | 3.054 | 3.651 |
| NIW je Anteil | $ 13,25 | $ 12,47 | $ 12,66 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 22.499 | CHF 22.233 | CHF 23.303 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.093 | 2.160 | 2.160 |
| NIW je Anteil | CHF 10,75 | CHF 10,29 | CHF 10,79 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 32.191 | € 31.461 | € 77.990 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.638 | 2.698 | 6.405 |
| NIW je Anteil | € 12,20 | € 11,66 | € 12,18 |
| ausschüttend II | € 529 | € 373 | € 32.224 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 62 | 45 | 3.472 |
| NIW je Anteil | € 8,52 | € 8,37 | € 9,28 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 10 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,30 | $ 10,50 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO Credit Opportunities Bond Fund (Fortsetzung)** | | | |
| Erträge | k. A. | $ 10 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,62 | $ 10,27 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 14.062 | $ 15.542 | $ 18.521 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.246 | 1.456 | 1.693 |
| NIW je Anteil | $ 11,29 | $ 10,67 | $ 10,94 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 23.806 | € 24.225 | € 54.537 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.284 | 2.421 | 5.174 |
| NIW je Anteil | € 10,42 | € 10,00 | € 10,54 |
| G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 73 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 8 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 9,48 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 1.172 | € 1.134 | € 1.712 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 116 | 117 | 167 |
| NIW je Anteil | € 10,09 | € 9,70 | € 10,25 |
| **Diversified Income Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 8.639.676 | $ 6.819.035 | $ 7.918.902 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 517.873 | $ 336.872 | $ 287.237 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.628 | 14.769 | 12.435 |
| NIW je Anteil | $ 25,11 | $ 22,81 | $ 23,10 |
| Erträge | $ 118.060 | $ 75.080 | $ 72.704 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.760 | 5.319 | 4.873 |
| NIW je Anteil | $ 15,21 | $ 14,11 | $ 14,92 |
| Institutional CAD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CAD 24.207 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.290 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | CAD 10,57 | k. A. | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 10.716 | CHF 9.800 | CHF 11.755 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 772 | 764 | 876 |
| NIW je Anteil | CHF 13,88 | CHF 12,83 | CHF 13,42 |
| Erträge | CHF 2.680 | CHF 1.912 | CHF 2.319 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 285 | 215 | 240 |
| NIW je Anteil | CHF 9,40 | CHF 8,87 | CHF 9,68 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 914.468 | € 728.881 | € 918.478 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 52.374 | 45.235 | 54.721 |
| NIW je Anteil | € 17,46 | € 16,11 | € 16,78 |
| Erträge | € 751.946 | € 585.915 | € 384.525 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 75.235 | 62.199 | 37.534 |
| NIW je Anteil | € 9,99 | € 9,42 | € 10,24 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 959.733 | £ 943.787 | £ 981.839 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 68.111 | 72.974 | 73.724 |
| NIW je Anteil | £ 14,09 | £ 12,93 | £ 13,32 |
| Erträge | £ 626.632 | £ 585.651 | £ 574.861 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 85.197 | 84.942 | 77.547 |
| NIW je Anteil | £ 7,36 | £ 6,89 | £ 7,41 |
| Institutional SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 297.694 | SEK 274.672 | SEK 598.823 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.655 | 1.657 | 3.463 |
| NIW je Anteil | SEK 179,88 | SEK 165,79 | SEK 172,94 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 23.108 | $ 20.271 | $ 34.667 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.794 | 1.729 | 2.909 |
| NIW je Anteil | $ 12,88 | $ 11,73 | $ 11,92 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Diversified Income Fund (Forts.)** | | | |
| Erträge | $ 4.639 | $ 6.579 | $ 3.390 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 452 | 691 | 337 |
| NIW je Anteil | $ 10,26 | $ 9,52 | $ 10,06 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 12.549 | € 10.227 | € 14.159 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 750 | 661 | 875 |
| NIW je Anteil | € 16,74 | € 15,48 | € 16,18 |
| Erträge | € 3.170 | € 3.344 | € 3.632 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 336 | 376 | 375 |
| NIW je Anteil | € 9,44 | € 8,90 | € 9,67 |
| Administrative: | | | |
| Erträge | $ 24.575 | $ 14.506 | $ 15.722 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.190 | 1.393 | 1.429 |
| NIW je Anteil | $ 11,22 | $ 10,41 | $ 11,00 |
| Administrative AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 15 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 10,27 | k. A. | k. A. |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 5.323 | € 1.576 | € 3.109 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 324 | 104 | 195 |
| NIW je Anteil | € 16,44 | € 15,21 | € 15,93 |
| Administrative GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 3.206 | £ 2.924 | £ 2.746 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 298 | 290 | 253 |
| NIW je Anteil | £ 10,76 | £ 10,09 | £ 10,85 |
| Administrative SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 2.778 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 272 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 10,22 | k. A. | k. A. |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 448.109 | $ 355.573 | $ 443.537 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.079 | 17.459 | 21.310 |
| NIW je Anteil | $ 22,32 | $ 20,37 | $ 20,81 |
| Erträge | $ 558.334 | $ 437.960 | $ 548.435 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 41.125 | 34.767 | 41.196 |
| NIW je Anteil | $ 13,58 | $ 12,60 | $ 13,31 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 930.360 | € 734.955 | € 848.054 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 58.938 | 50.227 | 55.140 |
| NIW je Anteil | € 15,79 | € 14,63 | € 15,38 |
| Erträge | € 938.628 | € 685.235 | € 837.214 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 82.419 | 63.835 | 71.729 |
| NIW je Anteil | € 11,39 | € 10,73 | € 11,67 |
| G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 2.391 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 240 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 9,97 |
| G Retail EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 1.051 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 101 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,36 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 527.965 | $ 256.806 | $ 424.028 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 27.707 | 14.822 | 24.125 |
| NIW je Anteil | $ 19,06 | $ 17,33 | $ 17,58 |
| M Retail: | | | |
| Erträge | $ 141.043 | $ 95.646 | $ 104.094 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.151 | 8.878 | 9.145 |
| NIW je Anteil | $ 11,61 | $ 10,77 | $ 11,38 |
| ausschüttend II | $ 41.946 | $ 18.293 | $ 22.893 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.255 | 1.984 | 2.313 |
| NIW je Anteil | $ 9,86 | $ 9,22 | $ 9,90 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Diversified Income Fund (Forts.)** | | | |
| M Retail AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 30.447 | AUD 13.063 | AUD 32.382 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.739 | 1.260 | 2.950 |
| NIW je Anteil | AUD 11,12 | AUD 10,37 | AUD 10,98 |
| Class R: | | | |
| Erträge | k. A. | $ 1.538 | $ 1.000 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 159 | 98 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,66 | $ 10,21 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | $ 10.240 | $ 4.786 | $ 4.767 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 839 | 429 | 416 |
| NIW je Anteil | $ 12,21 | $ 11,17 | $ 11,46 |
| Erträge | $ 2.925 | $ 1.989 | $ 1.913 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 274 | 201 | 183 |
| NIW je Anteil | $ 10,66 | $ 9,89 | $ 10,46 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 29.648 | € 23.651 | € 31.415 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.647 | 2.273 | 2.861 |
| NIW je Anteil | € 11,20 | € 10,40 | € 10,98 |
| Erträge | € 22.997 | € 16.283 | € 63.955 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.358 | 1.771 | 6.399 |
| NIW je Anteil | € 9,75 | € 9,19 | € 9,99 |
| **Diversified Income Duration Hedged Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 1.373.716 | $ 1.273.910 | $ 1.258.972 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 103.859 | $ 136.181 | $ 122.146 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.407 | 10.348 | 9.205 |
| NIW je Anteil | $ 14,02 | $ 13,16 | $ 13,27 |
| Erträge | $ 4.289 | $ 5.168 | $ 4.434 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 399 | 501 | 409 |
| NIW je Anteil | $ 10,76 | $ 10,32 | $ 10,84 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 99.576 | € 78.320 | € 86.638 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.538 | 6.219 | 6.637 |
| NIW je Anteil | € 13,21 | € 12,59 | € 13,05 |
| ausschüttend II | € 108.211 | € 87.575 | € 196.530 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.370 | 10.243 | 21.133 |
| NIW je Anteil | € 8,75 | € 8,55 | € 9,30 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 422.152 | £ 353.571 | £ 326.098 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 30.011 | 26.501 | 23.842 |
| NIW je Anteil | £ 14,07 | £ 13,34 | £ 13,68 |
| Erträge | £ 52.187 | £ 59.864 | £ 52.472 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.613 | 6.644 | 5.449 |
| NIW je Anteil | £ 9,30 | £ 9,01 | £ 9,63 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 13.990 | $ 15.159 | $ 15.916 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.183 | 1.363 | 1.414 |
| NIW je Anteil | $ 11,83 | $ 11,12 | $ 11,25 |
| Erträge | $ 1.325 | $ 1.499 | $ 507 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 135 | 159 | 51 |
| NIW je Anteil | $ 9,80 | $ 9,40 | $ 9,88 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Diversified Income Duration Hedged Fund (Forts.)** | | | |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 40.628 | $ 40.860 | $ 33.684 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.448 | 3.678 | 2.981 |
| NIW je Anteil | $ 11,78 | $ 11,11 | $ 11,30 |
| Erträge | $ 38.667 | $ 41.744 | $ 52.688 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.780 | 4.255 | 5.113 |
| NIW je Anteil | $ 10,23 | $ 9,81 | $ 10,30 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 229.327 | € 214.475 | € 101.462 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.386 | 17.957 | 8.121 |
| NIW je Anteil | € 12,47 | € 11,94 | € 12,49 |
| Erträge | € 59.215 | € 60.087 | € 44.656 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.701 | 6.980 | 4.802 |
| NIW je Anteil | € 8,84 | € 8,61 | € 9,30 |
| Class R: | | | |
| Erträge | k. A. | $ 1.468 | $ 1.085 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 155 | 109 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,48 | $ 9,96 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | $ 2.047 | $ 1.772 | $ 915 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 179 | 164 | 83 |
| NIW je Anteil | $ 11,43 | $ 10,80 | $ 11,02 |
| **Dynamic Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 3.985.782 | $ 3.087.145 | $ 2.525.901 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 979.454 | $ 828.361 | $ 779.728 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 71.243 | 62.320 | 59.527 |
| NIW je Anteil | $ 13,75 | $ 13,29 | $ 13,10 |
| Erträge | $ 55.982 | $ 22.386 | $ 5.120 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.021 | 2.045 | 459 |
| NIW je Anteil | $ 11,15 | $ 10,95 | $ 11,17 |
| Institutional CAD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CAD 23.787 | CAD 23.088 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.308 | 2.307 | k. A. |
| NIW je Anteil | CAD 10,31 | CAD 10,01 | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 68.831 | CHF 66.943 | CHF 57.212 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.383 | 6.312 | 5.303 |
| NIW je Anteil | CHF 10,78 | CHF 10,61 | CHF 10,79 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 832.652 | € 585.054 | € 518.887 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 65.398 | 46.804 | 40.985 |
| NIW je Anteil | € 12,73 | € 12,50 | € 12,66 |
| Erträge | € 24.140 | € 21.879 | € 27.428 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.347 | 2.133 | 2.550 |
| NIW je Anteil | € 10,29 | € 10,26 | € 10,76 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 785.090 | £ 657.755 | £ 233.999 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 62.593 | 53.732 | 19.091 |
| NIW je Anteil | £ 12,54 | £ 12,24 | £ 12,26 |
| Erträge | £ 213.877 | £ 5.735 | £ 5.666 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 21.852 | 591 | 563 |
| NIW je Anteil | £ 9,79 | £ 9,70 | £ 10,06 |
| Institutional NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 216.346 | NOK 183.987 | NOK 353.896 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17.329 | 15.123 | 29.113 |
| NIW je Anteil | NOK 12,48 | NOK 12,17 | NOK 12,16 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Dynamic Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 498.667 | SEK 485.358 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.937 | 4.900 | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK 101,01 | SEK 99,05 | k. A. |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 72.095 | $ 62.980 | $ 41.821 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.127 | 5.527 | 3.711 |
| NIW je Anteil | $ 11,77 | $ 11,40 | $ 11,27 |
| Erträge | $ 4.674 | $ 3.604 | $ 2.844 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 468 | 368 | 285 |
| NIW je Anteil | $ 9,98 | $ 9,80 | $ 9,99 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 4.135 | € 4.409 | € 5.284 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 377 | 409 | 482 |
| NIW je Anteil | € 10,96 | € 10,77 | € 10,95 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 30.437 | $ 30.079 | $ 31.704 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.321 | 2.367 | 2.519 |
| NIW je Anteil | $ 13,11 | $ 12,71 | $ 12,59 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 14.068 | € 9.990 | € 41.801 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.158 | 836 | 3.435 |
| NIW je Anteil | € 12,15 | € 11,95 | € 12,17 |
| Administrative SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 125.587 | SEK 141.214 | SEK 196.318 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.134 | 1.297 | 1.770 |
| NIW je Anteil | SEK 110,75 | SEK 108,87 | SEK 110,94 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 96.863 | $ 77.913 | $ 68.849 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.410 | 6.965 | 6.190 |
| NIW je Anteil | $ 11,52 | $ 11,19 | $ 11,12 |
| Erträge | $ 25.095 | $ 22.625 | $ 51.833 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.463 | 2.261 | 5.080 |
| NIW je Anteil | $ 10,19 | $ 10,01 | $ 10,20 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 15.234 | CHF 16.233 | CHF 21.407 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.532 | 1.653 | 2.124 |
| NIW je Anteil | CHF 9,94 | CHF 9,82 | CHF 10,08 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 152.192 | € 175.105 | € 218.090 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.026 | 15.197 | 18.520 |
| NIW je Anteil | € 11,68 | € 11,52 | € 11,78 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 3.679 | £ 4.328 | £ 5.624 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 325 | 390 | 501 |
| NIW je Anteil | £ 11,32 | £ 11,10 | £ 11,22 |
| G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 47 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 5 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 9,54 |
| G Retail EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | € 27.617 | € 30.455 | € 34.606 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.973 | 3.324 | 3.598 |
| NIW je Anteil | € 9,29 | € 9,16 | € 9,62 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 10 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,36 | $ 10,03 | k. A. |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Dynamic Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 9.595 | $ 10.062 | $ 9.125 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 853 | 925 | 850 |
| NIW je Anteil | $ 11,25 | $ 10,89 | $ 10,74 |
| Erträge | k. A. | $ 404 | $ 509 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 42 | 53 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,50 | $ 9,68 |
| Class Z AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 53.034 | AUD 56.432 | AUD 49.330 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.118 | 5.522 | 4.722 |
| NIW je Anteil | AUD 10,36 | AUD 10,22 | AUD 10,45 |
| **Dynamic Multi-Asset Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 1.349.594 | € 1.187.964 | € 1.033.781 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 532.162 | € 607.651 | € 500.270 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 46.838 | 56.248 | 43.742 |
| NIW je Anteil | € 11,36 | € 10,80 | € 11,44 |
| ausschüttend II | € 30.638 | € 27.711 | € 61.986 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.742 | 2.594 | 5.459 |
| NIW je Anteil | € 11,17 | € 10,68 | € 11,35 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 1.490 | CHF 1.419 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 150 | 150 | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 9,94 | CHF 9,46 | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 128.093 | £ 1.620 | £ 1.485 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.926 | 146 | 128 |
| NIW je Anteil | £ 11,72 | £ 11,09 | £ 11,62 |
| Erträge | £ 8 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 10,36 | k. A. | k. A. |
| Institutional USD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | $ 53.447 | $ 46.619 | $ 40.153 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.356 | 4.058 | 3.397 |
| NIW je Anteil | $ 12,27 | $ 11,49 | $ 11,82 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | € 584.022 | € 497.206 | € 425.880 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 53.262 | 47.456 | 37.997 |
| NIW je Anteil | € 10,96 | € 10,48 | € 11,21 |
| Erträge | € 654 | € 8 | € 8 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 67 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | € 9,72 | € 9,29 | € 9,94 |
| Class E USD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | $ 980 | $ 823 | $ 4.675 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 91 | 82 | 445 |
| NIW je Anteil | $ 10,73 | $ 10,10 | $ 10,50 |
| Erträge | k. A. | $ 10 | $ 13 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,10 | $ 10,50 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Dynamic Multi-Asset Fund (Forts.)** | | | |
| G Institutional: | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 300 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 29 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,30 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | € 9.819 | € 10.813 | € 6.321 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 957 | 1.100 | 599 |
| NIW je Anteil | € 10,26 | € 9,83 | € 10,55 |
| **Emerging Asia Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 35.608 | $ 33.569 | $ 39.966 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 18 | $ 18 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 2 | 2 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,84 | $ 10,91 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 24 | € 33 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 2 | 2 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 14,27 | € 13,67 |
| Class E: | | | |
| Erträge | $ 20.735 | $ 20.730 | $ 25.579 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.391 | 2.550 | 2.980 |
| NIW je Anteil | $ 8,67 | $ 8,13 | $ 8,58 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 6.599 | € 4.385 | € 3.594 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 466 | 338 | 287 |
| NIW je Anteil | € 14,16 | € 12,97 | € 12,53 |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 57.483 | HKD 60.923 | HKD 78.271 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.606 | 8.579 | 10.455 |
| NIW je Anteil | HKD 7,56 | HKD 7,10 | HKD 7,49 |
| **Emerging Local Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 2.475.105 | $ 2.281.384 | $ 3.008.766 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 936.206 | $ 803.263 | $ 592.053 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 69.143 | 65.667 | 44.585 |
| NIW je Anteil | $ 13,54 | $ 12,23 | $ 13,28 |
| Erträge | $ 91.019 | $ 84.676 | $ 683.235 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.576 | 11.588 | 81.096 |
| NIW je Anteil | $ 7,86 | $ 7,31 | $ 8,42 |
| Institutional CHF (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 2.927 | CHF 99.114 | CHF 113.911 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 301 | 11.162 | 11.954 |
| NIW je Anteil | CHF 9,72 | CHF 8,88 | CHF 9,53 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 140.696 | € 141.660 | € 251.016 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.728 | 12.001 | 20.577 |
| NIW je Anteil | € 13,12 | € 11,80 | € 12,20 |
| Erträge | € 780.641 | € 703.795 | € 761.754 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 98.090 | 95.520 | 94.167 |
| NIW je Anteil | € 7,96 | € 7,37 | € 8,09 |
| Institutional GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | £ 100.973 | £ 78.090 | £ 84.385 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.806 | 4.117 | 4.353 |
| NIW je Anteil | £ 21,01 | £ 18,97 | £ 19,39 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 27.338 | $ 13.014 | $ 11.918 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.645 | 1.392 | 1.170 |
| NIW je Anteil | $ 10,33 | $ 9,35 | $ 10,19 |
| Investor CHF (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 1.354 | CHF 1.481 | CHF 2.050 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 128 | 153 | 196 |
| NIW je Anteil | CHF 10,61 | CHF 9,71 | CHF 10,45 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Emerging Local Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Investor EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 4.493 | € 4.005 | € 3.960 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 367 | 363 | 346 |
| NIW je Anteil | € 12,24 | € 11,03 | € 11,44 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 52.918 | $ 45.471 | $ 52.921 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.337 | 4.105 | 4.357 |
| NIW je Anteil | $ 12,20 | $ 11,08 | $ 12,15 |
| Erträge | $ 23.666 | $ 21.049 | $ 23.735 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.215 | 3.077 | 3.009 |
| NIW je Anteil | $ 7,36 | $ 6,84 | $ 7,89 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 109.151 | € 98.642 | € 102.979 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.395 | 7.389 | 7.390 |
| NIW je Anteil | € 14,76 | € 13,35 | € 13,94 |
| Erträge | € 2.549 | € 2.503 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 236 | 250 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,80 | € 10,02 | k. A. |
| G Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 28.090 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 2.973 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 9,45 |
| G Retail EUR (Unhedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 4.594 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 563 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 8,16 |
| Class T EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 267 | € 97 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 29 | 10 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,39 | € 9,84 |
| Class Z: | | | |
| Erträge | $ 29.517 | $ 25.422 | $ 27.847 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.132 | 2.903 | 2.757 |
| NIW je Anteil | $ 9,42 | $ 8,76 | $ 10,10 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Emerging Markets Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 3.751.921 | $ 2.428.290 | $ 3.324.965 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 567.755 | $ 451.690 | $ 421.362 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.370 | 10.050 | 8.969 |
| NIW je Anteil | $ 49,93 | $ 44,94 | $ 46,98 |
| Erträge | $ 84.627 | $ 61.887 | $ 86.402 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.429 | 3.517 | 4.505 |
| NIW je Anteil | $ 19,11 | $ 17,60 | $ 19,18 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| Erträge | CHF 82.198 | CHF 74.264 | CHF 79.222 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.066 | 3.921 | 3.717 |
| NIW je Anteil | CHF 20,21 | CHF 18,94 | CHF 21,32 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 751.226 | € 289.777 | € 477.012 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17.895 | 7.549 | 11.549 |
| NIW je Anteil | € 41,98 | € 38,38 | € 41,30 |
| Erträge | € 1.119.463 | € 780.440 | € 991.292 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 117.886 | 87.843 | 99.416 |
| NIW je Anteil | € 9,50 | € 8,88 | € 9,97 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 140.313 | € 42.284 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.038 | 4.045 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 11,66 | € 10,45 | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 19.873 | £ 16.476 | £ 257.097 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 734 | 669 | 9.811 |
| NIW je Anteil | £ 27,09 | £ 24,63 | £ 26,20 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Emerging Markets Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Erträge | £ 95.801 | £ 73.667 | £ 69.803 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.266 | 16.748 | 14.300 |
| NIW je Anteil | £ 4,73 | £ 4,40 | £ 4,88 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 2.842 | SGD 1.023 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 257 | 102 | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 11,07 | SGD 10,01 | k. A. |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 6.185 | $ 5.710 | $ 7.138 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 132 | 135 | 160 |
| NIW je Anteil | $ 47,03 | $ 42,41 | $ 44,49 |
| Erträge | k. A. | $ 486 | $ 1.061 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 42 | 85 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 11,52 | $ 12,55 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 3.837 | € 3.317 | € 5.185 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 97 | 92 | 133 |
| NIW je Anteil | € 39,40 | € 36,09 | € 38,96 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 26.702 | $ 25.139 | $ 30.087 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 578 | 603 | 687 |
| NIW je Anteil | $ 46,22 | $ 41,70 | $ 43,81 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 91.861 | $ 64.370 | $ 99.556 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.067 | 1.602 | 2.349 |
| NIW je Anteil | $ 44,44 | $ 40,18 | $ 42,38 |
| Erträge | $ 115.814 | $ 122.046 | $ 147.729 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.062 | 11.511 | 12.781 |
| NIW je Anteil | $ 11,51 | $ 10,60 | $ 11,56 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 160.938 | € 129.651 | € 119.656 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.315 | 3.785 | 3.218 |
| NIW je Anteil | € 37,29 | € 34,25 | € 37,19 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 13.851 | SGD 10.254 | SGD 12.231 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 217 | 177 | 198 |
| NIW je Anteil | SGD 63,89 | SGD 58,00 | SGD 61,72 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 101.250 | $ 42.097 | $ 41.318 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.068 | 954 | 895 |
| NIW je Anteil | $ 48,96 | $ 44,10 | $ 46,18 |
| M Retail: | | | |
| Erträge | $ 13.721 | $ 18.302 | $ 25.294 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.326 | 1.919 | 2.434 |
| NIW je Anteil | $ 10,35 | $ 9,54 | $ 10,39 |
| ausschüttend II | $ 2.306 | $ 1.681 | $ 4.609 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 249 | 195 | 483 |
| NIW je Anteil | $ 9,27 | $ 8,61 | $ 9,54 |
| M Retail AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 13.202 | AUD 4.171 | AUD 12.442 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.354 | 462 | 1.261 |
| NIW je Anteil | AUD 9,75 | AUD 9,03 | AUD 9,87 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 583 | € 221 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 60 | 21 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,77 | € 10,65 |
| Class Z: | | | |
| Erträge | $ 10.797 | $ 9.108 | $ 4.110 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 850 | 778 | 322 |
| NIW je Anteil | $ 12,70 | $ 11,70 | $ 12,75 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Emerging Markets Corporate Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 234.276 | $ 194.608 | $ 233.998 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 38.805 | $ 31.371 | $ 26.491 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.327 | 2.057 | 1.722 |
| NIW je Anteil | $ 16,68 | $ 15,25 | $ 15,38 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 90.834 | € 69.004 | € 84.518 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.113 | 4.999 | 5.903 |
| NIW je Anteil | € 14,86 | € 13,80 | € 14,32 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 5.510 | £ 5.212 | £ 64 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 582 | 582 | 7 |
| NIW je Anteil | £ 9,47 | £ 8,96 | £ 9,63 |
| Administrative: | | | |
| Erträge | k. A. | $ 473 | $ 691 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 52 | 72 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,04 | $ 9,55 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 16.335 | $ 12.728 | $ 20.403 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.255 | 1.065 | 1.677 |
| NIW je Anteil | $ 13,01 | $ 11,96 | $ 12,17 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 19.575 | CHF 19.988 | CHF 26.397 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.696 | 1.852 | 2.328 |
| NIW je Anteil | CHF 11,54 | CHF 10,79 | CHF 11,34 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 39.139 | € 35.883 | € 45.324 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.909 | 2.858 | 3.449 |
| NIW je Anteil | € 13,45 | € 12,55 | € 13,14 |
| Class Z: | | | |
| Erträge | $ 4.033 | $ 3.220 | $ 3.324 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 375 | 319 | 312 |
| NIW je Anteil | $ 10,76 | $ 10,08 | $ 10,65 |
| **PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 128.437 | k. A. | k. A. |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 495 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 48 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,30 | k. A. | k. A. |
| Institutional EUR (Partially Hedged): | | k. A. | k. A. |
| thesaurierend | € 112.348 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.000 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,21 | k. A. | k. A. |
| **Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 70.336 | $ 51.799 | $ 44.882 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 18.291 | $ 13.868 | $ 5.708 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.317 | 1.046 | 412 |
| NIW je Anteil | $ 13,89 | $ 13,25 | $ 13,86 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 18.952 | € 9.637 | € 9.522 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.388 | 743 | 737 |
| NIW je Anteil | € 13,66 | € 12,98 | € 12,92 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 7.939 | $ 7.719 | $ 7.821 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 628 | 637 | 612 |
| NIW je Anteil | $ 12,64 | $ 12,12 | $ 12,78 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (Forts.)** | | | |
| Erträge | $ 2.850 | $ 2.252 | $ 2.730 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 283 | 230 | 257 |
| NIW je Anteil | $ 10,07 | $ 9,78 | $ 10,60 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 17.275 | € 14.822 | € 14.314 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.292 | 1.161 | 1.116 |
| NIW je Anteil | € 13,37 | € 12,76 | € 12,82 |
| **Euro Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 2.494.366 | € 1.978.440 | € 1.264.884 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 1.867.656 | € 1.537.428 | € 1.074.100 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 72.538 | 63.271 | 44.517 |
| NIW je Anteil | € 25,75 | € 24,30 | € 24,13 |
| Erträge | € 85.983 | € 66.582 | € 60.087 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.075 | 4.145 | 3.737 |
| NIW je Anteil | € 16,94 | € 16,06 | € 16,08 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 341.270 | CHF 284.928 | CHF 7.238 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.565 | 8.442 | 215 |
| NIW je Anteil | CHF 35,68 | CHF 33,75 | CHF 33,67 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | € 34.913 | € 16.661 | € 12.132 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.439 | 726 | 531 |
| NIW je Anteil | € 24,26 | € 22,94 | € 22,85 |
| Erträge | € 752 | € 670 | € 1.772 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 46 | 44 | 115 |
| NIW je Anteil | € 16,26 | € 15,42 | € 15,44 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | € 5.185 | € 3.965 | € 3.854 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 221 | 179 | 174 |
| NIW je Anteil | € 23,43 | € 22,17 | € 22,12 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | € 150.333 | € 69.321 | € 73.882 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.584 | 3.203 | 3.408 |
| NIW je Anteil | € 22,83 | € 21,64 | € 21,68 |
| Erträge | € 42.184 | € 29.848 | € 31.553 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.420 | 2.552 | 2.693 |
| NIW je Anteil | € 12,34 | € 11,70 | € 11,72 |
| G Institutional: | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 539 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 48 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 11,12 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 1.126 | € 779 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 107 | 74 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,49 | € 10,54 |
| **Euro Credit Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 964.980 | € 742.058 | € 774.565 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 746.419 | € 540.002 | € 523.296 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 44.544 | 33.984 | 32.802 |
| NIW je Anteil | € 16,76 | € 15,89 | € 15,95 |
| ausschüttend II | € 116.041 | € 107.367 | € 159.753 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.368 | 10.028 | 14.603 |
| NIW je Anteil | € 11,19 | € 10,71 | € 10,94 |

| | | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|---|
| **Euro Credit Fund (Forts.)** | | | | |
| Class E: | | | | |
| thesaurierend | € | 102.502 € | 94.689 € | 91.516 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 7.538 | 7.308 | 6.967 |
| NIW je Anteil | € | 13,60 € | 12,96 € | 13,14 |
| H Institutional: | | | | |
| thesaurierend | € | 9 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 10,08 | k. A. | k. A. |
| ausschüttend II | € | 9 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € | 10,08 | k. A. | k. A. |
| **Euro Income Bond Fund** | | | | |
| Nettovermögen | € | 2.215.487 € | 1.487.943 € | 1.046.201 |
| Institutional: | | | | |
| thesaurierend | € | 395.753 € | 137.289 € | 73.968 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 26.036 | 9.484 | 5.042 |
| NIW je Anteil | € | 15,20 € | 14,48 € | 14,67 |
| Erträge | € | 213.777 € | 136.490 € | 51.352 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 19.357 | 12.797 | 4.620 |
| NIW je Anteil | € | 11,04 € | 10,67 € | 11,11 |
| Institutional USD (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | | k. A. $ | 61.102 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | 6.029 | k. A. |
| NIW je Anteil | | k. A. $ | 10,13 | k. A. |
| Investor: | | | | |
| Erträge | € | 16.105 € | 7.453 € | 9.412 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.478 | 707 | 854 |
| NIW je Anteil | € | 10,89 € | 10,54 € | 11,02 |
| Class E: | | | | |
| Thesaurierend | € | 808.102 € | 497.356 € | 263.809 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 57.313 | 36.875 | 19.127 |
| NIW je Anteil | € | 14,10 € | 13,49 € | 13,79 |
| Erträge | € | 739.428 € | 631.047 € | 630.215 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 72.572 | 63.836 | 60.611 |
| NIW je Anteil | € | 10,19 € | 9,89 € | 10,40 |
| Class T: | | | | |
| thesaurierend | € | 27.670 € | 15.624 € | 10.179 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.514 | 1.481 | 940 |
| NIW je Anteil | € | 11,01 € | 10,55 € | 10,83 |
| Erträge | € | 14.652 € | 9.234 € | 7.266 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.599 | 1.036 | 772 |
| NIW je Anteil | € | 9,16 € | 8,91 € | 9,41 |
| **Euro Long Average Duration Fund** | | | | |
| Nettovermögen | € | 291.959 € | 253.994 € | 254.382 |
| Institutional: | | | | |
| thesaurierend | € | 291.959 € | 253.994 € | 254.382 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 10.107 | 10.071 | 10.482 |
| NIW je Anteil | € | 28,89 € | 25,22 € | 24,27 |
| **Euro Low Duration Fund** | | | | |
| Nettovermögen | € | 335.277 € | 313.942 € | 434.279 |
| Institutional: | | | | |
| thesaurierend | € | 315.253 € | 294.611 € | 418.083 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 27.514 | 25.986 | 36.496 |
| NIW je Anteil | € | 11,46 € | 11,34 € | 11,46 |
| Institutional AUD (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | | k. A. | k. A. AUD | 10.689 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | k. A. | 1.000 |
| NIW je Anteil | | k. A. | k. A. AUD | 10,69 |

| | | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|---|
| **Euro Low Duration Fund (Forts.)** | | | | |
| Class E: | | | | |
| thesaurierend | € | 20.024 € | 19.331 € | 9.234 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.000 | 1.943 | 911 |
| NIW je Anteil | € | 10,01 € | 9,95 € | 10,14 |
| **Euro Short-Term Fund** | | | | |
| Nettovermögen | € | 712.701 € | 775.039 € | 1.458.614 |
| Institutional: | | | | |
| thesaurierend | € | 373.664 € | 425.920 € | 1.015.934 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 30.930 | 35.354 | 83.123 |
| NIW je Anteil | € | 12,08 € | 12,05 € | 12,22 |
| ausschüttend II | € | 100 € | 100 € | 96.124 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 10 | 10 | 9.714 |
| NIW je Anteil | € | 9,74 € | 9,73 € | 9,90 |
| Class E: | | | | |
| thesaurierend | € | 338.937 € | 349.019 € | 346.556 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 30.988 | 31.881 | 30.971 |
| NIW je Anteil | € | 10,94 € | 10,95 € | 11,19 |
| **Global Advantage Fund** | | | | |
| Nettovermögen | $ | 801.784 $ | 731.946 $ | 789.081 |
| Institutional: | | | | |
| thesaurierend | $ | 33.533 $ | 22.082 $ | 23.161 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.366 | 1.655 | 1.675 |
| NIW je Anteil | $ | 14,17 $ | 13,34 $ | 13,83 |
| Institutional CHF (Partially Hedged): | | | | |
| Erträge | CHF | 123.774 CHF | 94.831 CHF | 114.924 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 11.764 | 9.333 | 10.725 |
| NIW je Anteil | CHF | 10,52 CHF | 10,16 CHF | 10,71 |
| Institutional DKK (Partially Hedged): | | | | |
| thesaurierend | DKK | 558.131 DKK | 584.772 DKK | 597.128 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 49.174 | 54.268 | 54.268 |
| NIW je Anteil | DKK | 11,35 DKK | 10,78 DKK | 11,00 |
| Institutional EUR (Partially Hedged): | | | | |
| thesaurierend | € | 389.974 € | 369.398 € | 366.096 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 29.082 | 29.035 | 28.210 |
| NIW je Anteil | € | 13,41 € | 12,72 € | 12,98 |
| Institutional GBP (Partially Hedged): | | | | |
| thesaurierend | £ | 32.374 £ | 27.380 £ | 27.637 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.568 | 2.299 | 2.301 |
| NIW je Anteil | £ | 12,60 £ | 11,91 £ | 12,01 |
| Institutional NOK (Partially Hedged): | | | | |
| thesaurierend | NOK | 463.618 NOK | 438.760 NOK | 441.591 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.316 | 3.313 | 3.309 |
| NIW je Anteil | NOK | 139,82 NOK | 132,42 NOK | 133,47 |
| Class E: | | | | |
| thesaurierend | $ | 4.222 $ | 4.179 $ | 5.302 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 376 | 393 | 476 |
| NIW je Anteil | $ | 11,24 $ | 10,64 $ | 11,13 |
| Erträge | | k. A. $ | 118 $ | 138 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | 12 | 13 |
| NIW je Anteil | | k. A. $ | 9,86 $ | 10,45 |
| Class E EUR (Partially Hedged): | | | | |
| thesaurierend | € | 10.749 € | 10.473 € | 12.710 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 876 | 895 | 1.055 |
| NIW je Anteil | € | 12,27 € | 11,70 € | 12,05 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Global Advantage Real Return Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 77.147 | $ 87.854 | $ 126.444 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 11.226 | $ 11.257 | $ 16.496 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.146 | 1.237 | 1.730 |
| NIW je Anteil | $ 9,80 | $ 9,10 | $ 9,54 |
| Institutional CHF (Partially Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 9.662 | CHF 9.152 | CHF 9.889 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 925 | 932 | 971 |
| NIW je Anteil | CHF 10,44 | CHF 9,82 | CHF 10,18 |
| Institutional EUR (Partially Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 18.221 | € 22.069 | € 6.890 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.587 | 2.062 | 632 |
| NIW je Anteil | € 11,48 | € 10,71 | € 10,90 |
| Erträge | € 1.174 | € 8.477 | € 10.177 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 138 | 1.054 | 1.194 |
| NIW je Anteil | € 8,53 | € 8,05 | € 8,52 |
| ausschüttend II | k. A. | k. A. | € 9.460 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1.066 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 8,88 |
| Institutional GBP (Partially Hedged): | | | |
| Erträge | £ 4.491 | £ 4.509 | £ 9.507 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 460 | 490 | 986 |
| NIW je Anteil | £ 9,77 | £ 9,20 | £ 9,64 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 2.743 | $ 2.520 | $ 3.334 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 316 | 311 | 390 |
| NIW je Anteil | $ 8,68 | $ 8,10 | $ 8,56 |
| Class E EUR (Partially Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 11.781 | € 11.357 | € 33.430 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.224 | 1.260 | 3.606 |
| NIW je Anteil | € 9,62 | € 9,02 | € 9,27 |
| G Institutional EUR (Partially Hedged): | | | |
| Erträge | € 112 | € 95 | € 103 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11 | 10 | 11 |
| NIW je Anteil | € 9,72 | € 9,07 | € 9,62 |
| Class Z: | | | |
| Erträge | $ 11.923 | $ 11.041 | $ 11.487 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.513 | 1.491 | 1.424 |
| NIW je Anteil | $ 7,88 | $ 7,40 | $ 8,06 |
| **Global Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 13.932.271 | $ 10.900.009 | $ 10.419.008 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 3.706.407 | $ 2.942.707 | $ 2.640.065 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 112.320 | 94.738 | 85.867 |
| NIW je Anteil | $ 33,00 | $ 31,06 | $ 30,75 |
| Erträge | $ 160.684 | $ 109.166 | $ 107.382 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.314 | 5.935 | 5.786 |
| NIW je Anteil | $ 19,33 | $ 18,39 | $ 18,56 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Global Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional CAD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CAD 97.637 | CAD 92.321 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.196 | 9.192 | k. A. |
| NIW je Anteil | CAD 10,62 | CAD 10,04 | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 415.252 | CHF 377.748 | CHF 287.857 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.391 | 11.768 | 8.776 |
| NIW je Anteil | CHF 33,51 | CHF 32,10 | CHF 32,80 |
| Erträge | CHF 190.772 | CHF 152.310 | CHF 127.473 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.203 | 7.589 | 6.097 |
| NIW je Anteil | CHF 20,73 | CHF 20,07 | CHF 20,91 |
| Institutional EUR (Currency Exposure): | | | |
| thesaurierend | € 168.760 | € 84.430 | € 40.958 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.609 | 6.700 | 3.352 |
| NIW je Anteil | € 13,38 | € 12,60 | € 12,22 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 2.764.798 | € 1.907.996 | € 1.445.088 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 99.262 | 71.668 | 53.338 |
| NIW je Anteil | € 27,85 | € 26,62 | € 27,09 |
| Erträge | € 645.803 | € 403.248 | € 344.516 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 34.643 | 22.384 | 18.432 |
| NIW je Anteil | € 18,64 | € 18,01 | € 18,69 |
| ausschüttend II | € 5.111 | € 2.057 | € 30.947 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 518 | 215 | 3.105 |
| NIW je Anteil | € 9,87 | € 9,56 | € 9,97 |
| Institutional GBP (Currency Exposure): | | | |
| thesaurierend | £ 4.128 | £ 5.726 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 368 | 541 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 11,21 | £ 10,59 | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 131.135 | £ 109.958 | £ 56.406 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.938 | 5.240 | 2.672 |
| NIW je Anteil | £ 22,08 | £ 20,98 | £ 21,11 |
| Erträge | £ 507.324 | £ 432.593 | £ 537.676 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 36.575 | 32.466 | 39.338 |
| NIW je Anteil | £ 13,87 | £ 13,32 | £ 13,67 |
| Institutional ILS (Hedged): | | | |
| thesaurierend | ILS 462 | ILS 1.076 | ILS 916 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 29 | 71 | 60 |
| NIW je Anteil | ILS 15,83 | ILS 15,07 | ILS 15,25 |
| Institutional NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 4.474.176 | NOK 3.950.254 | NOK 4.619.407 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.521 | 19.094 | 22.248 |
| NIW je Anteil | NOK 218,03 | NOK 206,87 | NOK 207,63 |
| Institutional NZD (Hedged): | | | |
| Erträge | NZD 165.023 | NZD 117.083 | NZD 111.226 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.650 | 2.710 | 2.552 |
| NIW je Anteil | NZD 45,21 | NZD 43,20 | NZD 43,58 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | | |
| Institutional SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 1.139.713 | SEK 966.811 | SEK 1.213.289 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.331 | 4.735 | 5.835 |
| NIW je Anteil | SEK 213,81 | SEK 204,16 | SEK 207,94 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 83.765 | SGD 73.983 | SGD 74.426 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.660 | 4.357 | 4.393 |
| NIW je Anteil | SGD 17,98 | SGD 16,98 | SGD 16,94 |
| Institutional USD (Currency Exposure): | | | |
| thesaurierend | $ 430.288 | $ 366.876 | $ 361.581 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.357 | 12.050 | 11.661 |
| NIW je Anteil | $ 32,21 | $ 30,45 | $ 31,01 |
| Erträge | $ 28.987 | $ 24.473 | $ 9.181 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.331 | 1.176 | 425 |
| NIW je Anteil | $ 21,78 | $ 20,82 | $ 21,61 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 368.415 | $ 383.013 | $ 332.626 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.980 | 13.208 | 11.547 |
| NIW je Anteil | $ 30,75 | $ 29,00 | $ 28,80 |
| Erträge | $ 18.295 | $ 17.335 | $ 30.677 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.127 | 1.122 | 1.968 |
| NIW je Anteil | $ 16,23 | $ 15,45 | $ 15,59 |
| Investor CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 303.025 | CHF 291.127 | CHF 277.561 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 23.217 | 23.247 | 21.615 |
| NIW je Anteil | CHF 13,05 | CHF 12,52 | CHF 12,84 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 49.268 | € 40.383 | € 50.537 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.861 | 1.594 | 1.953 |
| NIW je Anteil | € 26,47 | € 25,34 | € 25,88 |
| Investor GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 4.282 | £ 5.305 | £ 4.225 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 204 | 265 | 209 |
| NIW je Anteil | £ 21,03 | £ 20,02 | £ 20,21 |
| Investor NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 116.464 | NOK 49.198 | NOK 62.933 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 559 | 249 | 316 |
| NIW je Anteil | NOK 208,28 | NOK 197,96 | NOK 199,39 |
| Investor USD (Currency Exposure): | | | |
| thesaurierend | $ 6.831 | $ 6.159 | $ 6.791 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 223 | 212 | 229 |
| NIW je Anteil | $ 30,64 | $ 29,01 | $ 29,65 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 9.568 | $ 14.587 | $ 18.633 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 318 | 514 | 660 |
| NIW je Anteil | $ 30,07 | $ 28,37 | $ 28,23 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 103 | € 99 | € 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10 | 10 | 1 |
| NIW je Anteil | € 10,52 | € 10,08 | € 10,31 |
| Administrative GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. £ | 243 £ | 1.047 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 16 | 69 |
| NIW je Anteil | k. A. £ | 14,85 £ | 15,23 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 368.618 | $ 260.347 | $ 240.402 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.606 | 9.417 | 8.706 |
| NIW je Anteil | $ 29,24 | $ 27,65 | $ 27,61 |
| Erträge | $ 248.683 | $ 373.228 | $ 326.585 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17.817 | 28.096 | 24.366 |
| NIW je Anteil | $ 13,96 | $ 13,28 | $ 13,40 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | Global Bond Fund (Forts.) | | |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 1.466 | CHF 260 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 142 | 26 | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 10,29 | CHF 9,90 | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 806.930 | € 653.622 | € 585.296 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 32.684 | 27.574 | 24.046 |
| NIW je Anteil | € 24,69 | € 23,70 | € 24,34 |
| Erträge | € 33.465 | € 24.105 | € 22.152 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.271 | 2.439 | 2.160 |
| NIW je Anteil | € 10,23 | € 9,88 | € 10,26 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 2.569 | £ 2.353 | £ 3.018 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 183 | 174 | 218 |
| NIW je Anteil | £ 14,05 | £ 13,49 | £ 13,84 |
| Class E USD (Currency Exposure): | | | |
| thesaurierend | $ 37.235 | $ 22.488 | $ 88.569 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.803 | 1.783 | 6.834 |
| NIW je Anteil | $ 13,28 | $ 12,61 | $ 12,96 |
| Erträge | $ 11.960 | $ 9.476 | $ 10.608 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.026 | 851 | 918 |
| NIW je Anteil | $ 11,65 | $ 11,13 | $ 11,56 |
| G Institutional: | | | |
| thesaurierend | k. A. | k. A. | $ 85.413 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 7.880 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | $ 10,84 |
| G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 1.693 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 167 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,15 |
| G Retail EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | € 158.530 | € 169.990 | € 238.238 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.287 | 17.073 | 23.056 |
| NIW je Anteil | € 10,37 | € 9,96 | € 10,33 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 522.396 | $ 257.460 | $ 426.531 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.275 | 8.514 | 14.224 |
| NIW je Anteil | $ 32,10 | $ 30,24 | $ 29,99 |
| Erträge | k. A. $ | 11 $ | 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. $ | 10,48 $ | 10,58 |
| M Retail: | | | |
| ausschüttend II | $ 13.047 | $ 1.668 | $ 911 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.265 | 169 | 90 |
| NIW je Anteil | $ 10,32 | $ 9,88 | $ 10,12 |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | |
| ausschüttend II | HKD 25.959 | HKD 16.480 | HKD 2.138 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.508 | 1.658 | 210 |
| NIW je Anteil | HKD 10,35 | HKD 9,94 | HKD 10,16 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 1.422 | $ 1.111 | $ 1.758 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 111 | 92 | 147 |
| NIW je Anteil | $ 12,80 | $ 12,06 | $ 11,97 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 7.040 | € 6.712 | € 1.815 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 598 | 596 | 158 |
| NIW je Anteil | € 11,77 | € 11,26 | € 11,49 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 3.006 | £ 1.669 | £ 1.577 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 276 | 159 | 147 |
| NIW je Anteil | £ 10,91 | £ 10,48 | £ 10,75 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Global Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Class R SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 94 | SEK 90 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | SEK 104,21 | SEK 99,65 | k. A. |
| Class R USD (Currency Exposure): | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 222 | $ 486 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 21 | 46 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,43 | $ 10,65 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | $ 21.152 | $ 11.305 | $ 9.096 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.832 | 1.034 | 830 |
| NIW je Anteil | $ 11,55 | $ 10,93 | $ 10,95 |
| Erträge | $ 4.137 | $ 2.876 | $ 3.913 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 372 | 272 | 366 |
| NIW je Anteil | $ 11,12 | $ 10,59 | $ 10,68 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 12.215 | € 12.296 | € 15.059 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.141 | 1.195 | 1.421 |
| NIW je Anteil | € 10,70 | € 10,29 | € 10,60 |
| **Global Bond ESG Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 677.496 | $ 506.382 | $ 286.096 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 57.101 | $ 13.011 | $ 9.399 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.156 | 1.249 | 906 |
| NIW je Anteil | $ 11,08 | $ 10,42 | $ 10,38 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 1.980 | CHF 2.202 | CHF 1.468 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 192 | 223 | 145 |
| NIW je Anteil | CHF 10,31 | CHF 9,87 | CHF 10,15 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 127.877 | € 113.672 | € 63.404 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.272 | 11.425 | 6.220 |
| NIW je Anteil | € 10,42 | € 9,95 | € 10,19 |
| Erträge | € 119.953 | € 67.993 | € 20.104 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.947 | 7.020 | 1.994 |
| NIW je Anteil | € 10,04 | € 9,69 | € 10,08 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 16.869 | £ 2.413 | £ 379 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.638 | 244 | 37 |
| NIW je Anteil | £ 10,30 | £ 9,88 | £ 10,16 |
| Institutional NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 2.104.861 | NOK 1.929.247 | NOK 1.066.960 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 195.325 | 188.867 | 103.421 |
| NIW je Anteil | NOK 10,78 | NOK 10,21 | NOK 10,32 |
| Institutional NZD (Hedged): | | | |
| Erträge | NZD 49.153 | NZD 46.409 | NZD 35.196 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.629 | 4.582 | 3.432 |
| NIW je Anteil | NZD 10,62 | NZD 10,13 | NZD 10,26 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Global Bond ESG Fund (Forts.)** | | | |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 636 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 60 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,69 | $ 10,07 | k. A. |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 10 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,39 | k. A. | k. A. |
| Erträge | $ 10 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,34 | k. A. | k. A. |
| Class E: | | | |
| Erträge | $ 30 | $ 115 | $ 16 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3 | 11 | 2 |
| NIW je Anteil | $ 10,33 | $ 10,15 | $ 10,28 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 16.919 | € 15.004 | € 14.231 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.656 | 1.531 | 1.405 |
| NIW je Anteil | € 10,22 | € 9,80 | € 10,13 |
| Class Z AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 21.123 | AUD 13.067 | AUD 2.325 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.979 | 1.283 | 225 |
| NIW je Anteil | AUD 10,67 | AUD 10,19 | AUD 10,33 |
| **Global Bond Ex-US Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 966.975 | $ 963.225 | $ 931.240 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 600.827 | $ 606.020 | $ 595.172 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25.617 | 27.372 | 27.575 |
| NIW je Anteil | $ 23,45 | $ 22,14 | $ 21,58 |
| Erträge | $ 46.892 | $ 46.002 | $ 62.737 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.820 | 2.901 | 3.989 |
| NIW je Anteil | $ 16,63 | $ 15,86 | $ 15,73 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 43.632 | € 42.179 | € 35.083 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.460 | 2.481 | 2.060 |
| NIW je Anteil | € 17,74 | € 17,00 | € 17,03 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 198 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 19 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 10,26 | k. A. | k. A. |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 12.017 | $ 10.009 | $ 7.914 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 537 | 473 | 382 |
| NIW je Anteil | $ 22,37 | $ 21,16 | $ 20,70 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 10.472 | $ 9.153 | $ 8.824 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 481 | 444 | 437 |
| NIW je Anteil | $ 21,78 | $ 20,61 | $ 20,19 |
| Class E: | | | |
| Erträge | $ 188.704 | $ 177.505 | $ 144.819 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.686 | 11.525 | 9.481 |
| NIW je Anteil | $ 16,15 | $ 15,40 | $ 15,27 |
| Class E USD (Currency Exposure): | | | |
| Erträge | $ 58.112 | $ 66.309 | $ 69.645 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.791 | 6.879 | 6.915 |
| NIW je Anteil | $ 10,03 | $ 9,64 | $ 10,07 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 11 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,62 | $ 10,03 | k. A. |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | Global High Yield Bond Fund | | |
| Nettovermögen | $ 3.783.293 | $ 3.153.872 | $ 5.349.958 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 662.406 | $ 580.306 | $ 855.877 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25.928 | 25.089 | 36.113 |
| NIW je Anteil | $ 25,55 | $ 23,13 | $ 23,70 |
| Erträge | $ 278.136 | $ 131.874 | $ 141.646 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 24.799 | 12.675 | 12.620 |
| NIW je Anteil | $ 11,22 | $ 10,40 | $ 11,22 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 37.423 | CHF 27.363 | CHF 30.053 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.209 | 1.755 | 1.823 |
| NIW je Anteil | CHF 16,94 | CHF 15,59 | CHF 16,49 |
| Erträge | CHF 15.306 | CHF 15.902 | CHF 17.642 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.659 | 1.828 | 1.820 |
| NIW je Anteil | CHF 9,23 | CHF 8,70 | CHF 9,69 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 762.652 | € 587.517 | € 996.069 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 32.618 | 27.328 | 43.987 |
| NIW je Anteil | € 23,38 | € 21,50 | € 22,64 |
| Erträge | € 205.912 | € 196.406 | € 245.176 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17.148 | 17.360 | 19.529 |
| NIW je Anteil | € 12,01 | € 11,31 | € 12,55 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 10.166 | £ 11.240 | £ 44.613 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 673 | 814 | 3.099 |
| NIW je Anteil | £ 15,10 | £ 13,81 | £ 14,40 |
| Erträge | £ 503.593 | £ 458.504 | £ 974.163 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 85.279 | 82.796 | 160.275 |
| NIW je Anteil | £ 5,91 | £ 5,54 | £ 6,08 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 15.909 | $ 14.632 | $ 8.285 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.308 | 1.327 | 731 |
| NIW je Anteil | $ 12,16 | $ 11,03 | $ 11,34 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 2.707 | € 1.943 | € 12.043 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 119 | 93 | 545 |
| NIW je Anteil | € 22,70 | € 20,91 | € 22,10 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 52.890 | $ 51.492 | $ 69.503 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.185 | 2.344 | 3.072 |
| NIW je Anteil | $ 24,20 | $ 21,97 | $ 22,62 |
| Erträge | $ 17.650 | $ 16.519 | $ 32.430 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.609 | 1.623 | 2.954 |
| NIW je Anteil | $ 10,97 | $ 10,18 | $ 10,98 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | € 2.129 | € 1.619 | € 3.338 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 214 | 172 | 320 |
| NIW je Anteil | € 9,97 | € 9,40 | € 10,42 |
| Administrative GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 1.733 | £ 1.625 | £ 3.022 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 164 | 163 | 277 |
| NIW je Anteil | £ 10,59 | £ 9,93 | £ 10,90 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 189.101 | $ 170.496 | $ 251.279 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.303 | 8.232 | 11.734 |
| NIW je Anteil | $ 22,78 | $ 20,71 | $ 21,41 |
| Erträge | $ 180.661 | $ 207.640 | $ 256.114 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.367 | 20.284 | 23.185 |
| NIW je Anteil | $ 11,04 | $ 10,24 | $ 11,05 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | Global High Yield Bond Fund (Forts.) | | |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 249.082 | € 220.315 | € 337.097 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.637 | 10.187 | 14.665 |
| NIW je Anteil | € 23,42 | € 21,63 | € 22,99 |
| Erträge | € 46.431 | € 42.446 | € 59.070 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.730 | 4.589 | 5.756 |
| NIW je Anteil | € 9,82 | € 9,25 | € 10,26 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 11.315 | £ 10.150 | £ 11.414 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 911 | 871 | 893 |
| NIW je Anteil | £ 12,42 | £ 11,65 | £ 12,79 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 4.401 | SGD 2.520 | SGD 2.353 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 421 | 259 | 223 |
| NIW je Anteil | SGD 10,44 | SGD 9,72 | SGD 10,57 |
| G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 2.265 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 225 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,05 |
| G Retail EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 5.993 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 597 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,04 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 85.840 | $ 16.371 | $ 149.750 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.476 | 732 | 6.522 |
| NIW je Anteil | $ 24,69 | $ 22,37 | $ 22,96 |
| Erträge | $ 13.820 | $ 10.308 | $ 14.814 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.389 | 1.117 | 1.488 |
| NIW je Anteil | $ 9,95 | $ 9,23 | $ 9,95 |
| M Retail: | | | |
| Erträge | $ 41.191 | $ 33.718 | $ 50.236 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.783 | 3.338 | 4.611 |
| NIW je Anteil | $ 10,89 | $ 10,10 | $ 10,89 |
| ausschüttend II | $ 51.081 | $ 37.741 | $ 46.123 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.521 | 4.363 | 4.871 |
| NIW je Anteil | $ 9,25 | $ 8,65 | $ 9,47 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 8.522 | $ 8.367 | $ 12.543 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 602 | 652 | 951 |
| NIW je Anteil | $ 14,16 | $ 12,84 | $ 13,19 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 2.210 | £ 2.816 | £ 1.600 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 226 | 308 | 159 |
| NIW je Anteil | £ 9,76 | £ 9,15 | £ 10,04 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | $ 6.706 | $ 6.304 | $ 7.806 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 545 | 563 | 671 |
| NIW je Anteil | $ 12,30 | $ 11,21 | $ 11,63 |
| Erträge | $ 3.210 | $ 3.081 | $ 5.597 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 312 | 323 | 544 |
| NIW je Anteil | $ 10,28 | $ 9,54 | $ 10,29 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 456 | € 1.617 | € 2.347 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 43 | 164 | 224 |
| NIW je Anteil | € 10,63 | € 9,83 | € 10,49 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund | | |
| Nettovermögen | $ 19.949.148 | $ 17.244.136 | $ 20.741.806 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 4.431.372 | $ 3.498.624 | $ 3.775.065 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 217.556 | 186.697 | 199.759 |
| NIW je Anteil | $ 20,37 | $ 18,74 | $ 18,90 |
| Erträge | $ 708.007 | $ 627.610 | $ 770.142 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 54.373 | 51.481 | 60.469 |
| NIW je Anteil | $ 13,02 | $ 12,19 | $ 12,74 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 881.442 | CHF 887.827 | CHF 904.368 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 50.498 | 54.331 | 53.159 |
| NIW je Anteil | CHF 17,45 | CHF 16,34 | CHF 17,01 |
| Erträge | CHF 48.223 | CHF 41.489 | CHF 73.272 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.148 | 4.650 | 7.612 |
| NIW je Anteil | CHF 9,37 | CHF 8,92 | CHF 9,63 |
| Institutional CZK (Hedged): | | | |
| Erträge | CZK 2.099.444 | CZK 1.898.569 | CZK 1.814.287 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 216.454 | 207.933 | 186.002 |
| NIW je Anteil | CZK 9,70 | CZK 9,13 | CZK 9,75 |
| Institutional EUR (Currency Exposure): | | | |
| thesaurierend | € 12.736 | € 5.360 | € 16.693 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 940 | 430 | 1.358 |
| NIW je Anteil | € 13,54 | € 12,46 | € 12,29 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 2.469.340 | € 2.477.747 | € 3.241.293 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 126.025 | 135.361 | 170.740 |
| NIW je Anteil | € 19,59 | € 18,30 | € 18,98 |
| Erträge | € 770.203 | € 730.673 | € 819.850 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 63.166 | 63.025 | 65.803 |
| NIW je Anteil | € 12,19 | € 11,59 | € 12,46 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 822.774 | £ 747.232 | £ 846.149 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 38.901 | 38.040 | 42.012 |
| NIW je Anteil | £ 21,15 | £ 19,64 | £ 20,14 |
| Erträge | £ 2.477.782 | £ 2.298.995 | £ 2.972.701 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 178.500 | 175.211 | 213.210 |
| NIW je Anteil | £ 13,88 | £ 13,12 | £ 13,94 |
| Institutional HUF (Hedged): | | | |
| Erträge | HUF 9.251.644 | HUF 8.618.175 | HUF 3.410.424 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 947.888 | 930.585 | 343.216 |
| NIW je Anteil | HUF 9,76 | HUF 9,26 | HUF 9,94 |
| Institutional ILS (Hedged): | | | |
| thesaurierend | ILS 250.386 | ILS 240.122 | ILS 293.653 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 15.571 | 16.034 | 19.023 |
| NIW je Anteil | ILS 16,08 | ILS 14,97 | ILS 15,44 |
| Institutional NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 374.803 | NOK 808.899 | NOK 1.171.267 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.490 | 5.795 | 8.205 |
| NIW je Anteil | NOK 150,53 | NOK 139,58 | NOK 142,76 |
| Institutional PLN (Hedged): | | | |
| Erträge | PLN 7.335 | PLN 9.489 | PLN 16.084 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 689 | 946 | 1.519 |
| NIW je Anteil | PLN 10,65 | PLN 10,03 | PLN 10,59 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | | |
| Institutional SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 3.240.525 | SEK 3.011.711 | SEK 1.199.605 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 195.940 | 195.169 | 74.896 |
| NIW je Anteil | SEK 16,54 | SEK 15,43 | SEK 16,02 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 24.333 | SGD 1.196 | SGD 1.277 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.267 | 119 | 120 |
| NIW je Anteil | SGD 10,73 | SGD 10,08 | SGD 10,62 |
| Institutional USD (Currency Exposure): | | | |
| thesaurierend | $ 96.221 | $ 92.224 | $ 231.850 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.236 | 6.472 | 15.706 |
| NIW je Anteil | $ 15,43 | $ 14,25 | $ 14,76 |
| Erträge | $ 18.786 | $ 26.401 | $ 56.258 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.879 | 2.809 | 5.575 |
| NIW je Anteil | $ 10,00 | $ 9,40 | $ 10,09 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 1.808.895 | $ 1.019.291 | $ 579.333 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 80.513 | 49.228 | 27.648 |
| NIW je Anteil | $ 22,47 | $ 20,70 | $ 20,95 |
| Erträge | $ 95.936 | $ 80.242 | $ 123.268 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.927 | 6.188 | 9.099 |
| NIW je Anteil | $ 13,85 | $ 12,97 | $ 13,55 |
| Investor AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 4.312 | AUD 332 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 410 | 34 | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 10,51 | AUD 9,89 | k. A. |
| Investor CAD (Hedged): | | | |
| Erträge | CAD 644 | CAD 331 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 61 | 34 | k. A. |
| NIW je Anteil | CAD 10,47 | CAD 9,86 | k. A. |
| Investor CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 19.425 | CHF 15.948 | CHF 12.618 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.501 | 1.314 | 995 |
| NIW je Anteil | CHF 12,94 | CHF 12,14 | CHF 12,68 |
| Erträge | CHF 14.856 | CHF 12.971 | CHF 12.751 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.231 | 1.129 | 1.029 |
| NIW je Anteil | CHF 12,06 | CHF 11,49 | CHF 12,40 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 54.798 | € 24.596 | € 45.946 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.929 | 1.405 | 2.522 |
| NIW je Anteil | € 18,71 | € 17,51 | € 18,22 |
| Erträge | € 20.171 | € 15.012 | € 86.852 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.578 | 1.235 | 6.649 |
| NIW je Anteil | € 12,78 | € 12,15 | € 13,06 |
| Investor GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 6.879 | £ 6.572 | £ 9.068 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 511 | 516 | 670 |
| NIW je Anteil | £ 13,47 | £ 12,73 | £ 13,53 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | Global Investment Grade Credit Fund (Forts.) | | |
| Investor RMB (Hedged): | | | |
| Erträge | CNH 1.761 | CNH 1.623 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 17 | 16 | k. A. |
| NIW je Anteil | CNH 106,57 | CNH 99,76 | k. A. |
| Investor SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 5.292 | SGD 14 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 506 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 10,46 | SGD 9,84 | k. A. |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 117.566 | $ 100.378 | $ 114.487 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.079 | 5.627 | 6.332 |
| NIW je Anteil | $ 19,34 | $ 17,84 | $ 18,08 |
| Erträge | $ 76.978 | $ 58.722 | $ 113.783 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.749 | 4.684 | 8.688 |
| NIW je Anteil | $ 13,39 | $ 12,54 | $ 13,10 |
| Administrative CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 1.531 | CHF 1.501 | CHF 1.645 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 134 | 140 | 146 |
| NIW je Anteil | CHF 11,45 | CHF 10,74 | CHF 11,24 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 16.150 | € 12.598 | € 21.854 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 910 | 758 | 1.261 |
| NIW je Anteil | € 17,76 | € 16,63 | € 17,33 |
| Erträge | € 9.084 | € 8.422 | € 5.476 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 736 | 718 | 434 |
| NIW je Anteil | € 12,34 | € 11,73 | € 12,61 |
| Administrative GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 15.306 | £ 16.099 | £ 16.506 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.142 | 1.271 | 1.227 |
| NIW je Anteil | £ 13,40 | £ 12,66 | £ 13,46 |
| Administrative HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 16.242 | HKD 9.459 | HKD 80.536 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.582 | 982 | 8.016 |
| NIW je Anteil | HKD 10,27 | HKD 9,63 | HKD 10,05 |
| Administrative SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 741.812 | SEK 542.860 | SEK 546.204 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 62.332 | 48.765 | 47.023 |
| NIW je Anteil | SEK 11,90 | SEK 11,13 | SEK 11,62 |
| Administrative SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 14.068 | SGD 13.220 | SGD 13.922 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.394 | 1.394 | 1.394 |
| NIW je Anteil | SGD 10,09 | SGD 9,48 | SGD 9,99 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 695.020 | $ 552.948 | $ 702.174 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 37.493 | 32.278 | 40.279 |
| NIW je Anteil | $ 18,54 | $ 17,13 | $ 17,43 |
| Erträge | $ 582.478 | $ 491.748 | $ 650.164 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 41.232 | 37.174 | 47.052 |
| NIW je Anteil | $ 14,13 | $ 13,23 | $ 13,82 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 164.092 | CHF 147.861 | CHF 125.012 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.686 | 13.114 | 10.555 |
| NIW je Anteil | CHF 11,99 | CHF 11,27 | CHF 11,84 |
| E Class EUR (Currency Exposure): | | | |
| Erträge | € 3.184 | € 2.985 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 298 | 298 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,68 | € 10,01 | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 496.880 | € 450.702 | € 581.919 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 28.577 | 27.623 | 34.083 |
| NIW je Anteil | € 17,39 | € 16,31 | € 17,07 |
| Erträge | € 307.896 | € 284.893 | € 302.293 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 29.285 | 28.497 | 28.137 |
| NIW je Anteil | € 10,51 | € 10,00 | € 10,74 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 30.211 | £ 32.762 | £ 39.802 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.160 | 2.478 | 2.833 |
| NIW je Anteil | £ 13,99 | £ 13,22 | £ 14,05 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 43.933 | SGD 34.380 | SGD 47.386 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.090 | 3.406 | 4.458 |
| NIW je Anteil | SGD 10,74 | SGD 10,09 | SGD 10,63 |
| G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 130 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 13 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,21 |
| G Retail EUR (Currency Exposure): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 6.218 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 572 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,87 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 147.936 | $ 113.366 | $ 124.072 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.939 | 5.775 | 6.257 |
| NIW je Anteil | $ 21,32 | $ 19,63 | $ 19,83 |
| Erträge | $ 4.839 | $ 74 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 460 | 7 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,52 | $ 9,85 | k. A. |
| M Retail: | | | |
| Erträge | $ 29.855 | $ 27.931 | $ 44.752 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.792 | 2.789 | 4.278 |
| NIW je Anteil | $ 10,69 | $ 10,01 | $ 10,46 |
| ausschüttend II | $ 118.791 | $ 86.386 | $ 156.169 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.695 | 9.019 | 15.402 |
| NIW je Anteil | $ 10,16 | $ 9,58 | $ 10,14 |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 21.609 | HKD 22.513 | HKD 250.769 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.105 | 2.337 | 24.955 |
| NIW je Anteil | HKD 10,26 | HKD 9,63 | HKD 10,05 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 18.260 | $ 15.564 | $ 17.490 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.399 | 1.294 | 1.439 |
| NIW je Anteil | $ 13,05 | $ 12,02 | $ 12,16 |
| Erträge | $ 5.615 | $ 4.375 | $ 5.919 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 530 | 441 | 571 |
| NIW je Anteil | $ 10,60 | $ 9,92 | $ 10,37 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | € 20.945 | € 20.288 | € 17.841 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.134 | 2.174 | 1.779 |
| NIW je Anteil | € 9,81 | € 9,33 | € 10,03 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 21.879 | £ 16.553 | £ 15.778 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.142 | 1.715 | 1.538 |
| NIW je Anteil | £ 10,21 | £ 9,65 | £ 10,26 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | $ 23.587 | $ 18.571 | $ 19.305 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.007 | 1.706 | 1.736 |
| NIW je Anteil | $ 11,75 | $ 10,88 | $ 11,12 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 7.219 | € 6.440 | € 7.885 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 663 | 629 | 733 |
| NIW je Anteil | € 10,89 | € 10,23 | € 10,75 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Global Investment Grade Credit ESG Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 73.769 | $ 42.731 | k. A. |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 12.993 | $ 11.151 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.190 | 1.113 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,92 | $ 10,02 | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 34.040 | CHF 30.654 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.203 | 3.089 | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 10,63 | CHF 9,92 | k. A. |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 576 | € 213 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 54 | 21 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,67 | € 9,94 | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 4.183 | £ 190 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 389 | 19 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 10,77 | £ 9,97 | k. A. |
| Erträge | £ 11.048 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.079 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 10,23 | k. A. | k. A. |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 5.823 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 580 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,04 | k. A. | k. A. |
| **Global Libor Plus Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 1.568.418 | $ 1.039.498 | $ 540.876 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 97.701 | $ 33.976 | $ 9.007 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.680 | 3.133 | 839 |
| NIW je Anteil | $ 11,26 | $ 10,84 | $ 10,73 |
| Erträge | $ 23.106 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.283 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,12 | k. A. | k. A. |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 51.300 | € 19.022 | € 103.774 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.917 | 1.864 | 9.992 |
| NIW je Anteil | € 10,43 | € 10,21 | € 10,39 |
| Erträge | € 27.726 | € 22.916 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.834 | 2.363 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,78 | € 9,70 | k. A. |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 789.934 | £ 743.817 | £ 301.051 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 73.091 | 70.782 | 28.480 |
| NIW je Anteil | £ 10,81 | £ 10,51 | £ 10,57 |
| Erträge | £ 259.777 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25.743 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 10,09 | k. A. | k. A. |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 10 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,43 | $ 10,07 | k. A. |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 12.977 | € 457 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.295 | 46 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,02 | € 9,82 | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 6.025 | € 8.507 | € 8 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 609 | 877 | 1 |
| NIW je Anteil | € 9,89 | € 9,70 | € 9,94 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Global Low Duration Real Return Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 1.119.636 | $ 1.154.274 | $ 2.197.467 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 126.950 | $ 147.957 | $ 583.308 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.796 | 14.279 | 56.437 |
| NIW je Anteil | $ 10,76 | $ 10,36 | $ 10,34 |
| Erträge | $ 10 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,17 | $ 9,85 | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 5.887 | CHF 6.259 | CHF 36.099 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 609 | 661 | 3.705 |
| NIW je Anteil | CHF 9,66 | CHF 9,47 | CHF 9,74 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 522.679 | € 517.285 | € 944.381 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 52.721 | 53.363 | 95.008 |
| NIW je Anteil | € 9,91 | € 9,69 | € 9,94 |
| Erträge | € 35.195 | € 34.463 | € 36.025 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.681 | 3.663 | 3.664 |
| NIW je Anteil | € 9,56 | € 9,41 | € 9,83 |
| ausschüttend II | € 2.550 | € 2.685 | € 18.189 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 275 | 294 | 1.897 |
| NIW je Anteil | € 9,26 | € 9,13 | € 9,59 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 27.645 | £ 24.857 | £ 21.783 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.715 | 2.511 | 2.170 |
| NIW je Anteil | £ 10,18 | £ 9,90 | £ 10,04 |
| Erträge | £ 145.250 | £ 133.866 | £ 131.136 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.837 | 13.982 | 13.252 |
| NIW je Anteil | £ 9,79 | £ 9,57 | £ 9,90 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 6.273 | $ 8.343 | $ 5.826 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 595 | 820 | 572 |
| NIW je Anteil | $ 10,55 | $ 10,17 | $ 10,18 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 9 | € 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,66 | € 9,94 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 28.382 | $ 37.397 | $ 42.361 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.768 | 3.771 | 4.244 |
| NIW je Anteil | $ 10,25 | $ 9,92 | $ 9,98 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 82.304 | € 103.449 | € 102.385 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.715 | 11.154 | 10.668 |
| NIW je Anteil | € 9,44 | € 9,28 | € 9,60 |
| **Global Multi-Asset Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 862.597 | $ 850.423 | $ 1.066.739 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 238.241 | $ 269.419 | $ 350.129 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.375 | 16.640 | 20.515 |
| NIW je Anteil | $ 17,81 | $ 16,19 | $ 17,07 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 120.053 | € 134.103 | € 182.482 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.226 | 8.745 | 11.131 |
| NIW je Anteil | € 16,61 | € 15,33 | € 16,39 |
| Erträge | € 1.096 | € 787 | € 9.450 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 109 | 83 | 898 |
| NIW je Anteil | € 10,03 | € 9,45 | € 10,52 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | £ 870 | £ 5.772 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 77 | 484 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 11,28 | £ 11,92 |
| Erträge | £ 3.848 | £ 4.902 | £ 5.184 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 363 | 493 | 474 |
| NIW je Anteil | £ 10,60 | £ 9,94 | £ 10,93 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Global Multi-Asset Fund (Forts.)** | | | |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 8.243 | $ 8.927 | $ 13.192 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 617 | 734 | 1.025 |
| NIW je Anteil | $ 13,37 | $ 12,17 | $ 12,87 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 37.434 | $ 35.311 | $ 44.207 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.368 | 2.442 | 2.866 |
| NIW je Anteil | $ 15,81 | $ 14,46 | $ 15,42 |
| Erträge | $ 7.110 | $ 6.336 | $ 6.442 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 731 | 698 | 639 |
| NIW je Anteil | $ 9,72 | $ 9,07 | $ 10,08 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 211.931 | € 180.748 | € 189.616 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.380 | 13.209 | 12.807 |
| NIW je Anteil | € 14,74 | € 13,68 | € 14,81 |
| Erträge | € 41.203 | € 30.794 | € 13.178 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.478 | 3.531 | 1.341 |
| NIW je Anteil | € 9,20 | € 8,72 | € 9,83 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 140.413 | $ 127.050 | $ 142.493 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.928 | 10.928 | 11.739 |
| NIW je Anteil | $ 12,85 | $ 11,62 | $ 12,14 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Global Real Return Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 2.101.005 | $ 1.947.570 | $ 2.197.667 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 486.501 | $ 415.135 | $ 439.066 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22.328 | 20.454 | 21.455 |
| NIW je Anteil | $ 21,79 | $ 20,30 | $ 20,46 |
| Erträge | $ 24.602 | $ 26.351 | $ 23.391 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.419 | 1.624 | 1.405 |
| NIW je Anteil | $ 17,34 | $ 16,23 | $ 16,65 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 45.794 | CHF 45.431 | CHF 69.968 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.198 | 3.346 | 4.952 |
| NIW je Anteil | CHF 14,32 | CHF 13,58 | CHF 14,13 |
| Erträge | CHF 46.203 | CHF 44.636 | CHF 47.905 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.438 | 4.501 | 4.559 |
| NIW je Anteil | CHF 10,41 | CHF 9,92 | CHF 10,51 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 380.504 | € 325.520 | € 382.057 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.569 | 17.703 | 20.047 |
| NIW je Anteil | € 19,44 | € 18,39 | € 19,06 |
| Erträge | € 115.529 | € 95.361 | € 72.280 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.590 | 6.593 | 4.735 |
| NIW je Anteil | € 15,22 | € 14,46 | € 15,26 |
| ausschüttend II | k. A. | k. A. | € 9.535 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 887 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,75 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 4.804 | £ 4.853 | £ 16.724 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 391 | 420 | 1.413 |
| NIW je Anteil | £ 12,30 | £ 11,56 | £ 11,84 |
| Erträge | £ 92.987 | £ 98.893 | £ 69.912 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.913 | 11.162 | 7.567 |
| NIW je Anteil | £ 9,38 | £ 8,86 | £ 9,24 |
| Institutional SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 2.206 | SEK 2.084 | SEK 2.161 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 21 | 21 | 21 |
| NIW je Anteil | SEK 105,04 | SEK 99,26 | SEK 102,90 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 135.095 | SGD 125.345 | SGD 126.652 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.398 | 8.335 | 8.290 |
| NIW je Anteil | SGD 16,09 | SGD 15,04 | SGD 15,28 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Global Real Return Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional USD (Currency Exposure): | | | |
| thesaurierend | $ 101.216 | $ 107.225 | $ 91.263 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.736 | 11.007 | 8.907 |
| NIW je Anteil | $ 10,40 | $ 9,74 | $ 10,25 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 49.050 | $ 62.833 | $ 71.817 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.380 | 3.267 | 3.691 |
| NIW je Anteil | $ 20,61 | $ 19,23 | $ 19,46 |
| Erträge | $ 5.682 | $ 4.765 | $ 4.409 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 375 | 336 | 303 |
| NIW je Anteil | $ 15,17 | $ 14,20 | $ 14,58 |
| Investor CHF (Hedged): | | | |
| Erträge | CHF 3.662 | CHF 3.779 | CHF 4.641 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 279 | 302 | 350 |
| NIW je Anteil | CHF 13,15 | CHF 12,53 | CHF 13,27 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 6.640 | € 6.254 | € 17.445 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 360 | 358 | 960 |
| NIW je Anteil | € 18,45 | € 17,47 | € 18,17 |
| Erträge | € 5.008 | € 4.360 | € 5.673 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 359 | 329 | 406 |
| NIW je Anteil | € 13,95 | € 13,25 | € 13,99 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 66.011 | $ 67.251 | $ 97.761 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.257 | 3.554 | 5.099 |
| NIW je Anteil | $ 20,27 | $ 18,92 | $ 19,17 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 125.643 | $ 133.498 | $ 137.691 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.512 | 7.396 | 7.498 |
| NIW je Anteil | $ 19,29 | $ 18,05 | $ 18,36 |
| Erträge | $ 25.064 | $ 30.273 | $ 33.315 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.704 | 2.198 | 2.357 |
| NIW je Anteil | $ 14,71 | $ 13,77 | $ 14,14 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 191.357 | € 199.930 | € 243.191 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.101 | 12.211 | 14.203 |
| NIW je Anteil | € 17,24 | € 16,37 | € 17,12 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 2.880 | £ 3.197 | £ 6.484 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 206 | 243 | 472 |
| NIW je Anteil | £ 13,95 | £ 13,17 | £ 13,74 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 58.473 | $ 20.650 | $ 35.646 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.752 | 1.042 | 1.782 |
| NIW je Anteil | $ 21,25 | $ 19,81 | $ 20,00 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 2.675 | $ 2.230 | $ 3.378 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 221 | 198 | 297 |
| NIW je Anteil | $ 12,08 | $ 11,27 | $ 11,39 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 807 | € 831 | € 4.507 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 73 | 79 | 414 |
| NIW je Anteil | € 11,06 | € 10,48 | € 10,89 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 19.486 | £ 18.011 | £ 15.040 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.667 | 1.637 | 1.331 |
| NIW je Anteil | £ 11,69 | £ 11,00 | £ 11,30 |
| Erträge | k. A. | £ 257 | £ 336 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 25 | 31 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 10,30 | £ 10,75 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 166 | € 379 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 17 | 37 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,64 | € 10,11 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Global Real Return Fund (Forts.)** | | | |
| Class Z AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 11.373 | AUD 10.714 | AUD 12.451 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 916 | 918 | 1.038 |
| NIW je Anteil | AUD 12,42 | AUD 11,67 | AUD 11,99 |
| **Income Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 73.241.564 | $ 55.918.429 | $ 72.274.750 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 9.130.721 | $ 6.882.590 | $ 11.258.242 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 598.612 | 480.518 | 787.801 |
| NIW je Anteil | $ 15,25 | $ 14,32 | $ 14,29 |
| Erträge | $ 3.602.955 | $ 2.554.060 | $ 2.974.371 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 306.036 | 226.674 | 254.535 |
| NIW je Anteil | $ 11,77 | $ 11,27 | $ 11,69 |
| Institutional AUD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | AUD 60.410 | AUD 51.425 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.692 | 5.140 | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 10,61 | AUD 10,00 | k. A. |
| Institutional BRL (Hedged): | | | |
| thesaurierend | $ 656.826 | $ 704.958 | $ 2.525.671 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 41.542 | 48.602 | 154.747 |
| NIW je Anteil | $ 15,81 | $ 14,50 | $ 16,32 |
| Institutional CAD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CAD 194.115 | CAD 191.007 | CAD 119.027 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.166 | 16.851 | 10.446 |
| NIW je Anteil | CAD 12,01 | CAD 11,33 | CAD 11,39 |
| Erträge | CAD 26.782 | CAD 20.780 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.587 | 2.085 | k. A. |
| NIW je Anteil | CAD 10,35 | CAD 9,97 | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 210.609 | CHF 194.167 | CHF 179.249 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.244 | 17.609 | 15.784 |
| NIW je Anteil | CHF 11,54 | CHF 11,03 | CHF 11,36 |
| Erträge | CHF 174.241 | CHF 126.715 | CHF 109.789 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.074 | 13.477 | 10.879 |
| NIW je Anteil | CHF 9,64 | CHF 9,40 | CHF 10,09 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 10.880.953 | € 7.263.923 | € 10.086.073 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 775.772 | 543.109 | 735.022 |
| NIW je Anteil | € 14,03 | € 13,37 | € 13,72 |
| Erträge | € 1.247.820 | € 1.028.287 | € 1.293.969 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 116.187 | 98.355 | 115.782 |
| NIW je Anteil | € 10,74 | € 10,45 | € 11,18 |
| ausschüttend II | € 49.542 | € 59.153 | € 219.517 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.026 | 6.231 | 21.782 |
| NIW je Anteil | € 9,86 | € 9,49 | € 10,08 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 1.058 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 102 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 10,35 | k. A. | k. A. |
| Erträge | £ 416.680 | £ 360.188 | £ 187.209 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 39.556 | 35.350 | 17.420 |
| NIW je Anteil | £ 10,53 | £ 10,19 | £ 10,75 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Income Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 2.505.398 | HKD 1.656.016 | HKD 2.402.771 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 232.716 | 160.389 | 224.833 |
| NIW je Anteil | HKD 10,77 | HKD 10,32 | HKD 10,69 |
| Institutional JPY (Hedged): | | | |
| thesaurierend | ¥ 1.065.506 | JPY 981.451 | JPY 1.018.284 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.034 | 1.000 | 1.014 |
| NIW je Anteil | ¥ 1.031,00 | JPY 981,00 | JPY 1.005,00 |
| Institutional NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 1.072.762 | NOK 1.168.389 | NOK 1.083.441 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.913 | 11.404 | 10.452 |
| NIW je Anteil | NOK 108,22 | NOK 102,44 | NOK 103,66 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 222.434 | SGD 104.040 | SGD 73.260 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.747 | 10.102 | 6.809 |
| NIW je Anteil | SGD 10,72 | SGD 10,30 | SGD 10,76 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 1.647.982 | $ 1.089.760 | $ 780.931 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 131.316 | 92.312 | 66.070 |
| NIW je Anteil | $ 12,55 | $ 11,80 | $ 11,82 |
| Erträge | $ 1.044.417 | $ 780.200 | $ 746.059 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 99.026 | 77.122 | 70.811 |
| NIW je Anteil | $ 10,55 | $ 10,12 | $ 10,54 |
| Investor AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 22.340 | AUD 7.837 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.183 | 795 | k. A. |
| NIW je Anteil | AUD 10,23 | AUD 9,86 | k. A. |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 2.152.499 | € 510.140 | € 736.891 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 190.999 | 47.393 | 66.492 |
| NIW je Anteil | € 11,27 | € 10,76 | € 11,08 |
| Erträge | € 50.799 | € 44.263 | € 55.004 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.330 | 4.760 | 5.508 |
| NIW je Anteil | € 9,53 | € 9,30 | € 9,99 |
| ausschüttend A | € 45.973 | € 45.525 | € 178.938 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.591 | 4.759 | 17.396 |
| NIW je Anteil | € 10,01 | € 9,57 | € 10,29 |
| Investor RMB (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CNH 40.088 | CNH 67 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 372 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | CNH 107,83 | CNH 101,42 | k. A. |
| Investor SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 26.662 | SGD 9.468 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.612 | 963 | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 10,21 | SGD 9,83 | k. A. |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 494.170 | $ 285.813 | $ 417.133 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 44.212 | 27.164 | 39.537 |
| NIW je Anteil | $ 11,18 | $ 10,52 | $ 10,55 |
| Erträge | $ 3.152.894 | $ 2.556.571 | $ 3.482.136 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 277.939 | 234.747 | 306.418 |
| NIW je Anteil | $ 11,34 | $ 10,89 | $ 11,36 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Income Fund (Forts.)** | | | |
| Administrative AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 286.958 | AUD 193.442 | AUD 232.558 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 27.286 | 19.093 | 21.988 |
| NIW je Anteil | AUD 10,52 | AUD 10,13 | AUD 10,58 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 217.558 | € 86.218 | € 61.906 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.324 | 8.011 | 5.579 |
| NIW je Anteil | € 11,26 | € 10,76 | € 11,09 |
| Erträge | € 523.382 | € 463.737 | € 285.030 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 54.025 | 49.048 | 28.062 |
| NIW je Anteil | € 9,69 | € 9,45 | € 10,16 |
| Administrative GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 160.866 | £ 107.848 | £ 128.386 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.324 | 11.278 | 12.646 |
| NIW je Anteil | £ 9,85 | £ 9,56 | £ 10,15 |
| Administrative HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 8.874.810 | HKD 6.083.489 | HKD 6.080.431 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 877.454 | 624.932 | 599.122 |
| NIW je Anteil | HKD 10,11 | HKD 9,73 | HKD 10,15 |
| Administrative SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 1.146.853 | SGD 1.030.567 | SGD 1.175.473 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 101.359 | 94.517 | 102.518 |
| NIW je Anteil | SGD 11,31 | SGD 10,90 | SGD 11,47 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 5.249.175 | $ 4.162.104 | $ 4.807.444 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 364.856 | 306.707 | 351.851 |
| NIW je Anteil | $ 14,39 | $ 13,57 | $ 13,66 |
| Erträge | $ 7.484.946 | $ 6.592.278 | $ 8.032.025 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 679.707 | 621.990 | 722.592 |
| NIW je Anteil | $ 11,01 | $ 10,60 | $ 11,12 |
| Class E AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 540.816 | AUD 355.748 | AUD 198.166 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 53.674 | 36.543 | 19.396 |
| NIW je Anteil | AUD 10,08 | AUD 9,73 | AUD 10,22 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 88.427 | CHF 88.897 | CHF 103.213 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.729 | 8.098 | 9.047 |
| NIW je Anteil | CHF 11,44 | CHF 10,98 | CHF 11,41 |
| Erträge | CHF 118.080 | CHF 107.978 | CHF 102.236 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12.864 | 11.994 | 10.466 |
| NIW je Anteil | CHF 9,18 | CHF 9,00 | CHF 9,77 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 5.140.693 | € 4.421.299 | € 5.737.395 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 388.961 | 349.261 | 437.788 |
| NIW je Anteil | € 13,22 | € 12,66 | € 13,11 |
| Erträge | € 6.174.965 | € 5.476.150 | € 5.859.938 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 613.947 | 556.122 | 550.550 |
| NIW je Anteil | € 10,06 | € 9,85 | € 10,64 |
| ausschüttend II | € 94.786 | € 36.332 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.269 | 3.673 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,23 | € 9,89 | k. A. |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Income Fund (Forts.)** | | | |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 243.604 | £ 167.065 | £ 92.574 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25.176 | 17.751 | 9.222 |
| NIW je Anteil | £ 9,68 | £ 9,41 | £ 10,04 |
| Class E HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 11.129.569 | HKD 8.248.912 | HKD 6.584.958 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.073.358 | 824.940 | 629.074 |
| NIW je Anteil | HKD 10,37 | HKD 10,00 | HKD 10,47 |
| Class E JPY (Hedged): | | | |
| thesaurierend | ¥ 1.013.911 | JPY 969.834 | JPY 1.015.325 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.000 | 1.000 | 1.014 |
| NIW je Anteil | ¥ 1.014,00 | JPY 970,00 | JPY 1.002,00 |
| Class E RMB (Hedged): | | | |
| Erträge | CNH 321.549 | CNH 237.470 | CNH 451.454 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.716 | 2.091 | 3.879 |
| NIW je Anteil | CNH 118,38 | CNH 113,58 | CNH 116,39 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 2.488.746 | SGD 1.951.313 | SGD 2.147.087 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 243.943 | 197.979 | 206.019 |
| NIW je Anteil | SGD 10,20 | SGD 9,86 | SGD 10,42 |
| G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 13.643 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1.338 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,20 |
| G Retail EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | € 33.298 | € 24.779 | € 671 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.392 | 2.635 | 68 |
| NIW je Anteil | € 9,82 | € 9,40 | € 9,88 |
| G Retail EUR (Unhedged): | | | |
| Erträge | € 9 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,17 | k. A. | k. A. |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 79.358 | $ 2.314 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.390 | 229 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,74 | $ 10,09 | k. A. |
| Erträge | $ 55.080 | $ 22.509 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.356 | 2.283 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,28 | $ 9,86 | k. A. |
| H Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 7.226 | € 3.745 | € 2.838 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 699 | 380 | 280 |
| NIW je Anteil | € 10,34 | € 9,86 | € 10,14 |
| Class R: | | | |
| Erträge | $ 45.554 | $ 36.653 | $ 32.575 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.380 | 3.676 | 3.139 |
| NIW je Anteil | $ 10,40 | $ 9,97 | $ 10,38 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | € 10.215 | € 6.848 | € 6.182 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.025 | 705 | 595 |
| NIW je Anteil | € 9,97 | € 9,71 | € 10,39 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Income Fund (Forts.)** | | | |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 46.269 | £ 44.583 | £ 59.056 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.162 | 4.140 | 5.183 |
| NIW je Anteil | £ 11,12 | £ 10,77 | £ 11,39 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | $ 235.743 | $ 171.658 | $ 146.103 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.683 | 15.165 | 12.770 |
| NIW je Anteil | $ 11,98 | $ 11,32 | $ 11,44 |
| Erträge | $ 99.969 | $ 83.726 | $ 76.172 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.127 | 8.791 | 7.592 |
| NIW je Anteil | $ 9,87 | $ 9,52 | $ 10,03 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 340.188 | € 316.914 | € 383.272 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 30.737 | 29.836 | 34.714 |
| NIW je Anteil | € 11,07 | € 10,62 | € 11,04 |
| Erträge | € 303.439 | € 273.475 | € 271.169 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 33.471 | 30.740 | 28.073 |
| NIW je Anteil | € 9,07 | € 8,90 | € 9,66 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 319.160 | $ 276.566 | $ 279.087 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.200 | 18.691 | 19.009 |
| NIW je Anteil | $ 15,80 | $ 14,80 | $ 14,68 |
| Class Z AUD (Hedged): | | | |
| Erträge | AUD 589.401 | AUD 439.621 | AUD 263.333 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 53.047 | 41.320 | 23.995 |
| NIW je Anteil | AUD 11,11 | AUD 10,64 | AUD 10,97 |
| **Inflation Strategy Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 71.175 | $ 76.181 | $ 89.502 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 53.025 | $ 29.343 | $ 29.467 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.286 | 3.238 | 3.102 |
| NIW je Anteil | $ 10,03 | $ 9,06 | $ 9,50 |
| Institutional EUR (Partially Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 50 | € 20.825 | € 22.062 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | 2.326 | 2.331 |
| NIW je Anteil | € 9,80 | € 8,95 | € 9,46 |
| Institutional GBP (Partially Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 2.439 | £ 2.871 | £ 5.624 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 230 | 298 | 564 |
| NIW je Anteil | £ 10,58 | £ 9,64 | £ 9,97 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 3.619 | $ 4.777 | $ 5.548 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 390 | 566 | 620 |
| NIW je Anteil | $ 9,29 | $ 8,44 | $ 8,96 |
| Erträge | k. A. | $ 1.006 | $ 1.656 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 121 | 187 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 8,28 | $ 8,84 |
| Class E EUR (Partially Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 7.440 | € 8.245 | € 9.576 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 825 | 994 | 1.080 |
| NIW je Anteil | € 9,02 | € 8,29 | € 8,87 |
| Erträge | € 2.544 | € 3.645 | € 6.022 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 288 | 448 | 688 |
| NIW je Anteil | € 8,83 | € 8,13 | € 8,75 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Low Average Duration Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 1.114.806 | $ 1.221.290 | $ 1.733.028 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 697.592 | $ 683.804 | $ 723.889 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 44.141 | 44.610 | 47.226 |
| NIW je Anteil | $ 15,80 | $ 15,33 | $ 15,33 |
| Erträge | $ 37.905 | $ 115.451 | $ 351.448 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.602 | 11.128 | 33.201 |
| NIW je Anteil | $ 10,52 | $ 10,38 | $ 10,59 |
| Institutional AUD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | k. A. | AUD 10.631 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1.005 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | AUD 10,58 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 78.366 | € 162.018 | € 234.106 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.525 | 15.800 | 22.207 |
| NIW je Anteil | € 10,41 | € 10,25 | € 10,54 |
| Erträge | € 2.943 | € 6.761 | € 44.624 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 370 | 848 | 5.338 |
| NIW je Anteil | € 7,96 | € 7,97 | € 8,36 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 50.218 | £ 5.705 | £ 333 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.973 | 577 | 33 |
| NIW je Anteil | £ 10,10 | £ 9,89 | £ 10,05 |
| Erträge | £ 24.862 | £ 15.193 | £ 9.779 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.541 | 1.560 | 968 |
| NIW je Anteil | £ 9,78 | £ 9,74 | £ 10,10 |
| Institutional ILS (Hedged): | | | |
| thesaurierend | ILS 139 | ILS 467 | ILS 75 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 12 | 41 | 6 |
| NIW je Anteil | ILS 11,59 | ILS 11,38 | ILS 11,63 |
| Institutional NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | k. A. | NOK 52.359 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 5.090 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | NOK 10,29 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 57.644 | $ 71.843 | $ 94.030 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.843 | 4.930 | 6.429 |
| NIW je Anteil | $ 15,00 | $ 14,57 | $ 14,63 |
| Erträge | $ 6.147 | $ 6.700 | $ 8.014 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 589 | 651 | 763 |
| NIW je Anteil | $ 10,44 | $ 10,29 | $ 10,50 |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 15.781 | $ 16.957 | $ 26.034 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.075 | 1.188 | 1.814 |
| NIW je Anteil | $ 14,68 | $ 14,28 | $ 14,35 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 53.967 | $ 68.456 | $ 88.240 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.281 | 5.573 | 7.119 |
| NIW je Anteil | $ 12,61 | $ 12,28 | $ 12,40 |
| Erträge | $ 8.419 | $ 9.521 | $ 25.506 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 774 | 887 | 2.330 |
| NIW je Anteil | $ 10,88 | $ 10,73 | $ 10,95 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 19.961 | € 21.740 | € 36.209 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.293 | 2.525 | 4.054 |
| NIW je Anteil | € 8,70 | € 8,61 | € 8,93 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 22.154 | $ 10 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.855 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 11,94 | $ 11,60 | $ 11,62 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Low Average Duration Fund (Forts.)** | | | |
| Erträge | $ 10 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,14 | $ 10,02 | k. A. |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 4.266 | $ 2.735 | $ 7.002 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 399 | 263 | 672 |
| NIW je Anteil | $ 10,70 | $ 10,39 | $ 10,42 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 1.112 | € 1.596 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 115 | 159 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,70 | € 10,00 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | £ 253 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 26 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | £ 9,69 |
| **Low Duration Global Investment Grade Credit Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 518.067 | $ 526.200 | $ 628.973 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 37.977 | $ 59.049 | $ 51.694 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.279 | 5.320 | 4.699 |
| NIW je Anteil | $ 11,58 | $ 11,10 | $ 11,00 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 225 | CHF 287 | CHF 1.419 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22 | 29 | 140 |
| NIW je Anteil | CHF 10,12 | CHF 9,87 | CHF 10,10 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 340.107 | € 335.782 | € 422.933 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 31.831 | 32.302 | 39.927 |
| NIW je Anteil | € 10,68 | € 10,39 | € 10,60 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 5.132 | £ 725 | £ 644 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 460 | 67 | 59 |
| NIW je Anteil | £ 11,15 | £ 10,79 | £ 10,88 |
| Institutional NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 571.228 | NOK 551.608 | NOK 253.080 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.519 | 5.518 | 2.518 |
| NIW je Anteil | NOK 103,51 | NOK 99,96 | NOK 100,51 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 16.698 | € 16.083 | € 30.108 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.641 | 1.617 | 2.945 |
| NIW je Anteil | € 10,18 | € 9,94 | € 10,23 |
| **Low Duration Income Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 402.494 | $ 377.768 | k. A. |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 44.006 | $ 32.860 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.184 | 3.271 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,52 | $ 10,04 | k. A. |
| Erträge | $ 3.576 | $ 3.688 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 352 | 373 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,17 | $ 9,89 | k. A. |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 1.743 | CHF 215 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 172 | 22 | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 10,15 | CHF 9,85 | k. A. |
| Erträge | CHF 10 | CHF 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 9,81 | CHF 9,70 | k. A. |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 306.246 | € 296.875 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 30.054 | 30.046 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,19 | € 9,88 | k. A. |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Low Duration Income Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 1.190 | £ 179 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 115 | 18 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 10,31 | £ 9,95 | k. A. |
| Erträge | £ 8 | £ 7 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 9,97 | £ 9,79 | k. A. |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 9 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,15 | € 9,86 | k. A. |
| Erträge | € 9 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,85 | € 9,72 | k. A. |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 1.452 | $ 1.061 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 139 | 106 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,43 | $ 10,00 | k. A. |
| Erträge | $ 10 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,16 | $ 9,88 | k. A. |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 10 | CHF 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 10,06 | CHF 9,81 | k. A. |
| Erträge | CHF 39 | CHF 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | CHF 9,81 | CHF 9,70 | k. A. |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 454 | € 17 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 45 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,10 | € 9,83 | k. A. |
| Erträge | € 466 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 47 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 9,85 | € 9,72 | k. A. |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | SGD 347 | SGD 333 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 34 | 34 | k. A. |
| NIW je Anteil | SGD 10,09 | SGD 9,84 | k. A. |
| **PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 257.200 | $ 246.190 | $ 379.335 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 68.614 | $ 28.979 | $ 41.057 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.260 | 4.096 | 5.144 |
| NIW je Anteil | $ 8,31 | $ 7,07 | $ 7,98 |
| Erträge | $ 87.173 | $ 75.317 | $ 94.646 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 13.416 | 13.227 | 13.915 |
| NIW je Anteil | $ 6,50 | $ 5,69 | $ 6,80 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 28.713 | € 96.080 | € 47.974 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.750 | 14.501 | 6.226 |
| NIW je Anteil | € 7,66 | € 6,63 | € 7,71 |
| Erträge | € 7.538 | € 6.712 | € 6.473 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.258 | 1.258 | 986 |
| NIW je Anteil | € 5,99 | € 5,34 | € 6,57 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 18.953 | £ 64 | £ 104 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.425 | 10 | 13 |
| NIW je Anteil | £ 7,81 | £ 6,73 | £ 7,75 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (Forts.)** | | | |
| Erträge | £ 11.057 | £ 8.325 | £ 79.297 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.813 | 1.540 | 12.033 |
| NIW je Anteil | £ 6,10 | £ 5,41 | £ 6,59 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 7.498 | $ 6.396 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 717 | 717 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,46 | $ 8,92 | k. A. |
| Erträge | $ 11 | $ 9 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,88 | $ 8,68 | k. A. |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 8 | € 7 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,23 | € 8,87 | k. A. |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 369 | $ 957 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 55 | 125 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 6,73 | $ 7,69 |
| Erträge | $ 6.850 | $ 4.120 | $ 4.702 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.116 | 761 | 718 |
| NIW je Anteil | $ 6,14 | $ 5,41 | $ 6,55 |
| ausschüttend II | $ 22 | $ 1.043 | $ 1.261 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4 | 193 | 193 |
| NIW je Anteil | $ 6,13 | $ 5,41 | $ 6,54 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. € | 793 € | 19.870 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 126 | 2.681 |
| NIW je Anteil | k. A. € | 6,29 € | 7,41 |
| Erträge | k. A. € | 734 € | 32 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 145 | 5 |
| NIW je Anteil | k. A. € | 5,05 € | 6,31 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. £ | 5 £ | 12 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 2 |
| NIW je Anteil | k. A. £ | 6,66 £ | 7,69 |
| Erträge | k. A. £ | 4 £ | 5 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. £ | 5,33 £ | 6,53 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 7.547 | k. A. | $ 40.001 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 743 | k. A. | 3.963 |
| NIW je Anteil | $ 10,16 | k. A. | $ 10,09 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Mortgage Opportunities Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 1.631.758 | $ 2.183.029 | $ 1.484.592 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 432.292 | $ 420.894 | $ 363.204 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 39.861 | 39.936 | 34.794 |
| NIW je Anteil | $ 10,84 | $ 10,53 | $ 10,44 |
| Erträge | $ 340.554 | $ 390.633 | $ 288.682 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 34.147 | 39.498 | 28.423 |
| NIW je Anteil | $ 9,97 | $ 9,89 | $ 10,16 |
| ausschüttend II | $ 69 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,75 | $ 9,70 | k. A. |
| Institutional BRL (Hedged): | | | |
| thesaurierend | $ 4.562 | $ 4.325 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 478 | 478 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 9,55 | $ 9,06 | k. A. |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Mortgage Opportunities Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 60.051 | CHF 57.726 | CHF 15.437 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.940 | 5.778 | 1.511 |
| NIW je Anteil | CHF 10,11 | CHF 9,99 | CHF 10,22 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 227.419 | € 500.784 | € 244.386 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22.248 | 49.681 | 23.808 |
| NIW je Anteil | € 10,22 | € 10,08 | € 10,26 |
| Erträge | € 10.447 | € 13.823 | € 17.975 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.114 | 1.463 | 1.802 |
| NIW je Anteil | € 9,38 | € 9,45 | € 9,97 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 9.683 | £ 5.985 | £ 2.368 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 925 | 583 | 229 |
| NIW je Anteil | £ 10,47 | £ 10,26 | £ 10,33 |
| Erträge | £ 10.710 | £ 12.562 | £ 2.062 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.113 | 1.304 | 205 |
| NIW je Anteil | £ 9,62 | £ 9,63 | £ 10,05 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 19.704 | $ 19.889 | $ 12.548 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.870 | 1.940 | 1.231 |
| NIW je Anteil | $ 10,54 | $ 10,25 | $ 10,19 |
| Erträge | $ 4.380 | $ 4.234 | $ 19.835 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 439 | 428 | 1.954 |
| NIW je Anteil | $ 9,97 | $ 9,88 | $ 10,15 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 100 | € 99 | € 11.051 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10 | 10 | 1.098 |
| NIW je Anteil | € 9,97 | € 9,85 | € 10,07 |
| Administrative: | | | |
| Erträge | $ 783 | $ 776 | $ 807 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 78 | 78 | 79 |
| NIW je Anteil | $ 9,98 | $ 9,89 | $ 10,16 |
| Administrative SGD (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. SGD | 404 SGD | 214 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 41 | 21 |
| NIW je Anteil | k. A. SGD | 9,78 SGD | 10,12 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 80.688 | $ 169.343 | $ 206.524 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.598 | 16.344 | 19.933 |
| NIW je Anteil | $ 10,62 | $ 10,36 | $ 10,36 |
| Erträge | $ 12.905 | $ 24.104 | $ 95.598 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.293 | 2.435 | 9.403 |
| NIW je Anteil | $ 9,98 | $ 9,90 | $ 10,17 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| Erträge | CHF 362 | CHF 555 | CHF 49 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 39 | 60 | 5 |
| NIW je Anteil | CHF 9,21 | CHF 9,29 | CHF 9,85 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 58.653 | € 76.899 | € 74.547 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.867 | 7.764 | 7.324 |
| NIW je Anteil | € 10,00 | € 9,90 | € 10,18 |
| Erträge | € 6.032 | € 10.348 | € 306 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 648 | 1.104 | 31 |
| NIW je Anteil | € 9,31 | € 9,38 | € 9,90 |
| Class E HKD (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | HKD 80 | HKD 78 | HKD 78 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8 | 8 | 8 |
| NIW je Anteil | HKD 10,21 | HKD 9,99 | HKD 9,97 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 90 | SGD 2.168 | SGD 189 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9 | 217 | 19 |
| NIW je Anteil | SGD 10,22 | SGD 10,01 | SGD 10,08 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Mortgage Opportunities Fund (Forts.)** | | | |
| Erträge | SGD 8.086 | SGD 8.557 | SGD 8.710 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 823 | 875 | 861 |
| NIW je Anteil | SGD 9,82 | SGD 9,77 | SGD 10,12 |
| G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 319 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 32 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 9,92 |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 80 | HKD 78 | HKD 78 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8 | 8 | 8 |
| NIW je Anteil | HKD 9,72 | HKD 9,66 | HKD 9,91 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 353 | € 354 | € 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 36 | 37 | 1 |
| NIW je Anteil | € 9,67 | € 9,59 | € 9,90 |
| Class Z EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 69.276 | € 41.640 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 6.905 | 4.103 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,03 | € 10,15 |
| Class Z GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 233.191 | £ 227.839 | £ 58 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 22.764 | 22.764 | 6 |
| NIW je Anteil | £ 10,24 | £ 10,01 | £ 10,01 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **PIMCO RAE Emerging Markets Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 117.667 | $ 94.740 | $ 82.721 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 8.239 | $ 7.558 | $ 9.568 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 663 | 666 | 737 |
| NIW je Anteil | $ 12,42 | $ 11,35 | $ 12,98 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 33.982 | € 22.574 | € 7.956 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.798 | 2.042 | 661 |
| NIW je Anteil | € 12,14 | € 11,06 | € 12,04 |
| Institutional GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | £ 381 | £ 325 | £ 103 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25 | 23 | 7 |
| NIW je Anteil | £ 15,33 | £ 14,00 | £ 15,08 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 2.270 | $ 1.641 | $ 2.094 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 189 | 149 | 165 |
| NIW je Anteil | $ 12,00 | $ 11,01 | $ 12,71 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 6.478 | € 4.921 | € 4.022 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 552 | 459 | 341 |
| NIW je Anteil | € 11,74 | € 10,73 | € 11,78 |
| Class R GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | £ 9 | £ 401 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 27 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 13,94 | £ 15,04 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 270 | $ 287 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 25 | 23 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,85 | $ 12,58 |
| Class T EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 543 | € 380 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 51 | 32 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,58 | € 11,67 |
| Class Z EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 53.211 | € 46.183 | € 46.012 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.755 | 4.551 | 4.195 |
| NIW je Anteil | € 11,19 | € 10,15 | € 10,97 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **PIMCO RAE Europe Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 7.477 | € 8.125 | € 13.813 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 922 | € 1.268 | € 8.273 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 86 | 131 | 750 |
| NIW je Anteil | € 10,76 | € 9,69 | € 11,04 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO RAE Europe Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | £ 13 | £ 12 | £ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | £ 13,59 | £ 12,27 | £ 13,82 |
| Institutional USD (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | $ 4.176 | $ 4.476 | $ 3.500 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 380 | 450 | 294 |
| NIW je Anteil | $ 11,00 | $ 9,94 | $ 11,89 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | € 2.829 | € 2.751 | € 2.478 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 272 | 293 | 229 |
| NIW je Anteil | € 10,40 | € 9,40 | € 10,81 |
| Class E USD (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | $ 50 | $ 10 | $ 24 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5 | 1 | 2 |
| NIW je Anteil | $ 10,64 | $ 9,65 | $ 11,65 |
| Class R GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | £ 8 | £ 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 12,16 | £ 13,74 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 151 | € 95 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 16 | 9 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,27 | € 10,69 |
| Class T USD (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 10 | $ 12 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,51 | $ 11,53 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **PIMCO RAE Global Developed Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 51.648 | $ 31.939 | $ 103.100 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 4.068 | $ 3.373 | $ 7.502 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 328 | 303 | 594 |
| NIW je Anteil | $ 12,40 | $ 11,12 | $ 12,62 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 11.869 | € 11.546 | € 65.335 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 977 | 1.064 | 5.575 |
| NIW je Anteil | € 12,14 | € 10,85 | € 11,72 |
| Institutional GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | £ 522 | £ 372 | £ 401 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 34 | 27 | 27 |
| NIW je Anteil | £ 15,33 | £ 13,73 | £ 14,67 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 40 | $ 113 | $ 170 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3 | 10 | 14 |
| NIW je Anteil | $ 11,99 | $ 10,80 | $ 12,36 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 29.293 | € 12.677 | € 13.503 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.498 | 1.205 | 1.178 |
| NIW je Anteil | € 11,73 | € 10,52 | € 11,47 |
| Class R GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | £ 9 | £ 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 13,62 | £ 14,59 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 40 | $ 12 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 4 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,65 | $ 12,23 |
| Class T EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 208 | € 160 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 20 | 14 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,38 | € 11,35 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | | |
| Nettovermögen | $ 24.374 | $ 33.392 | $ 83.679 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 1.897 | $ 10.510 | $ 17.212 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 143 | 877 | 1.230 |
| NIW je Anteil | $ 13,30 | $ 11,99 | $ 13,99 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 397 | € 3.367 | € 28.345 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 26 | 244 | 1.850 |
| NIW je Anteil | € 15,36 | € 13,79 | € 15,32 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 18.274 | € 15.996 | € 26.517 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.358 | 1.315 | 1.936 |
| NIW je Anteil | € 13,45 | € 12,16 | € 13,69 |
| G Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| Erträge | € 1.054 | € 641 | € 476 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 68 | 46 | 31 |
| NIW je Anteil | € 15,54 | € 13,95 | € 15,49 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 15 | $ 14 | $ 16 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 15,19 | $ 13,61 | $ 15,70 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | | |
| Nettovermögen | $ 185.370 | $ 217.558 | $ 421.968 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 2.972 | $ 9.277 | $ 12.282 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 197 | 694 | 800 |
| NIW je Anteil | $ 15,05 | $ 13,37 | $ 15,36 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 54.041 | € 46.595 | € 87.539 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.394 | 4.205 | 6.832 |
| NIW je Anteil | € 12,30 | € 11,08 | € 12,81 |
| ausschüttend II | k. A. | k. A. | € 48.653 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 4.522 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,76 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 474 | € 340 | € 339 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 27 | 22 | 20 |
| NIW je Anteil | € 17,38 | € 15,38 | € 16,82 |
| ausschüttend II | k. A. | k. A. | € 13.552 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 1.310 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,34 |
| Institutional GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | £ 28 | £ 25 | £ 72 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2 | 2 | 4 |
| NIW je Anteil | £ 18,37 | £ 16,31 | £ 17,64 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | k. A. | k. A. | $ 1.433 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 107 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | $ 13,44 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 99.680 | € 130.185 | € 185.336 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.656 | 12.467 | 15.148 |
| NIW je Anteil | € 11,52 | € 10,44 | € 12,23 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 5.415 | € 4.633 | € 3.983 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 346 | 332 | 258 |
| NIW je Anteil | € 15,66 | € 13,94 | € 15,45 |
| G Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| Erträge | € 525 | € 419 | € 501 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 34 | 31 | 34 |
| NIW je Anteil | € 15,25 | € 13,50 | € 14,76 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | PIMCO RAE PLUS US Fund | | |
| Nettovermögen | k. A. | $ 123.755 | $ 149.038 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 113.287 | $ 131.103 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 7.395 | 7.780 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 15,32 | $ 16,85 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 8.585 | € 13.984 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 486 | 756 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 17,67 | € 18,51 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 642 | $ 1.019 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 51 | 72 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 12,65 | $ 14,09 |
| G Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 92 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 7 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 13,30 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 13 | $ 14 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 12,53 | $ 13,67 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | PIMCO RAE US Fund | | |
| Nettovermögen | $ 13.063 | $ 11.525 | $ 14.083 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 11.255 | $ 9.908 | $ 12.713 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 843 | 843 | 994 |
| NIW je Anteil | $ 13,35 | $ 11,75 | $ 12,79 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 12 | € 10 | € 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | € 13,11 | € 11,50 | € 11,87 |
| Institutional GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | £ 14 | £ 12 | £ 84 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 6 |
| NIW je Anteil | £ 16,49 | £ 14,51 | £ 14,87 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 440 | $ 162 | $ 43 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 34 | 14 | 3 |
| NIW je Anteil | $ 12,90 | $ 11,41 | $ 12,52 |
| Class E EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 1.174 | € 904 | € 907 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 93 | 81 | 78 |
| NIW je Anteil | € 12,61 | € 11,11 | € 11,62 |
| Class R GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | £ 9 | £ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 14,37 | £ 14,76 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 349 | $ 12 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 31 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 11,25 | $ 12,40 |
| Class T EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 29 | € 71 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 3 | 6 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 10,96 | € 11,50 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund | | |
| Nettovermögen | $ 10.883 | 9.889 | k. A. |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 10.861 | $ 9.870 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 998 | 998 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,88 | $ 9,89 | k. A. |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Emerging Markets Equity Fund (Fortsetzung)** | | | |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 10 | € 9 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,89 | € 9,86 | k. A. |
| Institutional GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | £ 8 | £ 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 10,98 | £ 9,97 | k. A. |
| **PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund** | | | |
| Nettovermögen | € 4.683 | € 4.104 | k. A. |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | € 4.673 | € 4.096 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 434 | 434 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,77 | € 9,44 | k. A. |
| Institutional USD (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | $ 11 | $ 9 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,76 | $ 9,47 | k. A. |
| **PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Global Developed Equity Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 5.286 | $ 4.623 | k. A. |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 5.265 | $ 4.605 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 498 | 498 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,57 | $ 9,25 | k. A. |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 9 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,58 | € 9,22 | k. A. |
| Institutional GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | £ 8 | £ 7 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 10,66 | £ 9,32 | k. A. |
| **PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 3.163 | $ 2.727 | k. A. |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 3.142 | $ 2.709 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 298 | 298 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,54 | $ 9,09 | k. A. |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | € 9 | € 8 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,55 | € 9,06 | k. A. |
| Institutional GBP (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | £ 8 | £ 7 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | £ 10,64 | £ 9,17 | k. A. |
| **Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 680.924 | $ 548.383 | $ 511.888 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 240.478 | $ 208.823 | $ 242.702 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 14.822 | 14.232 | 15.835 |
| NIW je Anteil | $ 16,22 | $ 14,67 | $ 15,32 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 226.406 | € 200.543 | € 203.189 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 18.877 | 18.201 | 17.150 |
| NIW je Anteil | € 11,99 | € 11,02 | € 11,85 |
| Erträge | € 157.315 | € 94.716 | € 18.143 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.632 | 10.650 | 1.817 |
| NIW je Anteil | € 9,46 | € 8,89 | € 9,98 |
| Investor NOK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | NOK 7.252 | NOK 6.653 | NOK 8.354 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 57 | 57 | 68 |
| NIW je Anteil | NOK 126,41 | NOK 115,56 | NOK 123,00 |
| Investor SEK (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SEK 18.165 | SEK 10.777 | SEK 19.563 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 155 | 100 | 168 |
| NIW je Anteil | SEK 117,54 | SEK 108,06 | SEK 116,83 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 576 | € 44 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 53 | 4 | k. A. |
| NIW je Anteil | € 10,78 | € 9,95 | k. A. |
| **StocksPLUS™ Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 2.927.404 | $ 2.299.203 | $ 1.695.478 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 2.504.021 | $ 1.913.160 | $ 1.354.271 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 70.221 | 64.141 | 42.763 |
| NIW je Anteil | $ 35,66 | $ 29,83 | $ 31,67 |
| Erträge | $ 36.900 | $ 30.930 | $ 50.256 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.419 | 1.420 | 2.173 |
| NIW je Anteil | $ 26,00 | $ 21,78 | $ 23,13 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 149.798 | € 141.088 | € 99.908 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 6.841 | 7.580 | 4.910 |
| NIW je Anteil | € 21,90 | € 18,61 | € 20,35 |
| Erträge | € 2.558 | € 4.255 | € 24.717 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 134 | 261 | 1.387 |
| NIW je Anteil | € 19,14 | € 16,30 | € 17,82 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 7.724 | $ 15.639 | $ 20.308 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 232 | 561 | 684 |
| NIW je Anteil | $ 33,28 | $ 27,88 | $ 29,71 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 76.775 | $ 64.510 | $ 48.851 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.413 | 2.413 | 1.705 |
| NIW je Anteil | $ 31,82 | $ 26,74 | $ 28,65 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 112.077 | € 94.492 | € 59.847 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 9.809 | 9.685 | 5.562 |
| NIW je Anteil | € 11,43 | € 9,76 | € 10,76 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | $ 847 | $ 754 | $ 234 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 64 | 68 | 20 |
| NIW je Anteil | $ 13,20 | $ 11,12 | $ 11,96 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **StocksPLUS™ Fund (Forts.)** | | | |
| Class Z: | | | |
| Erträge | | k. A. $ | 43 $ | 45 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | 1 | 2 |
| NIW je Anteil | | k. A. $ | 28,89 $ | 30,66 |
| **PIMCO StocksPLUS™ AR Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ | 5.268 | k. A. | k. A. |
| Institutional: | | | | |
| thesaurierend | $ | 5.257 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 499 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 10,54 | k. A. | k. A. |
| Class E: | | | | |
| thesaurierend | $ | 11 | k. A. | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1 | k. A. | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 10,51 | k. A. | k. A. |
| **Strategic Income Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ | 1.077.532 | $ | 899.132 $ | 785.534 |
| Institutional: | | | | |
| thesaurierend | $ | 28.210 | $ | 27.584 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.694 | 2.834 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ | 10,47 | $ | 9,73 | k. A. |
| Institutional EUR (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | € | 517.619 | € | 453.817 € | 439.923 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 40.884 | 37.991 | 34.972 |
| NIW je Anteil | € | 12,66 | € | 11,95 € | 12,58 |
| Class E: | | | | |
| thesaurierend | $ | 33.620 | $ | 26.404 $ | 22.069 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.629 | 2.212 | 1.780 |
| NIW je Anteil | $ | 12,79 | $ | 11,94 $ | 12,40 |
| ausschüttend II | $ | 20.538 | $ | 17.375 $ | 15.071 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.013 | 1.784 | 1.431 |
| NIW je Anteil | $ | 10,20 | $ | 9,74 $ | 10,53 |
| Class E EUR (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | € | 194.396 | € | 151.176 € | 102.670 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 16.161 | 13.262 | 8.476 |
| NIW je Anteil | € | 12,03 | € | 11,40 € | 12,11 |
| ausschüttend II | € | 126.959 | € | 87.071 € | 59.925 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 13.235 | 9.367 | 5.822 |
| NIW je Anteil | € | 9,59 | € | 9,30 € | 10,29 |
| G Institutional EUR (Hedged): | | | | |
| Erträge | | k. A. | k. A. € | 213 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | k. A. | k. A. | 20 |
| NIW je Anteil | | k. A. | k. A. € | 10,68 |
| Class T EUR (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | € | 25.637 | € | 23.148 € | 15.341 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.355 | 2.239 | 1.391 |
| NIW je Anteil | € | 10,89 | € | 10,34 € | 11,03 |
| Erträge | € | 9.259 | € | 8.901 € | 5.173 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 940 | 941 | 503 |
| NIW je Anteil | € | 9,85 | € | 9,46 € | 10,29 |
| **Total Return Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ | 4.887.588 $ | 4.899.730 $ | 6.394.519 |
| Institutional: | | | | |
| thesaurierend | $ | 1.326.369 $ | 1.180.325 $ | 1.518.212 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 42.976 | 40.684 | 51.782 |
| NIW je Anteil | $ | 30,86 $ | 29,01 $ | 29,32 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **Total Return Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Erträge | $ | 158.604 $ | 180.665 $ | 227.554 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 9.339 | 11.145 | 13.522 |
| NIW je Anteil | $ | 16,98 $ | 16,21 $ | 16,83 |
| Institutional CAD (Hedged): | | | | |
| Erträge | CAD | 22.605 CAD | 21.898 CAD | 4.540 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.266 | 2.288 | 453 |
| NIW je Anteil | CAD | 9,98 CAD | 9,57 CAD | 10,01 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | CHF | 11.322 CHF | 10.779 CHF | 26.653 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.005 | 1.000 | 2.370 |
| NIW je Anteil | CHF | 11,27 CHF | 10,78 CHF | 11,25 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | € | 331.759 € | 445.069 € | 598.839 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 15.082 | 21.199 | 27.447 |
| NIW je Anteil | € | 22,00 € | 20,99 € | 21,82 |
| Erträge | € | 174.366 € | 157.064 € | 157.618 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 12.090 | 11.235 | 10.559 |
| NIW je Anteil | € | 14,42 € | 13,98 € | 14,93 |
| Institutional EUR (Unhedged): | | | | |
| thesaurierend | € | 17.326 € | 26.611 € | 14.381 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 640 | 1.049 | 589 |
| NIW je Anteil | € | 27,09 € | 25,37 € | 24,41 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | £ | 13.799 £ | 12.816 £ | 14.563 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.025 | 1.004 | 1.110 |
| NIW je Anteil | £ | 13,46 £ | 12,77 £ | 13,12 |
| Erträge | £ | 38.198 £ | 43.164 £ | 55.756 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.898 | 4.572 | 5.595 |
| NIW je Anteil | £ | 9,80 £ | 9,44 £ | 9,97 |
| Institutional ILS (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | ILS | 2.542 ILS | 2.835 ILS | 4.192 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 190 | 223 | 319 |
| NIW je Anteil | ILS | 13,38 ILS | 12,73 ILS | 13,15 |
| Institutional JPY (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | ¥ | 212.276 JPY | 188.233 JPY | 1.751.987 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 199 | 185 | 1.657 |
| NIW je Anteil | ¥ | 1.069,00 JPY | 1.019,00 JPY | 1.057,00 |
| Institutional SGD (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | SGD | 32.002 SGD | 30.149 SGD | 30.587 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 2.442 | 2.438 | 2.429 |
| NIW je Anteil | SGD | 13,11 SGD | 12,36 SGD | 12,59 |
| Investor: | | | | |
| thesaurierend | $ | 460.226 $ | 444.421 $ | 544.684 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 16.040 | 16.450 | 19.880 |
| NIW je Anteil | $ | 28,69 $ | 27,02 $ | 27,40 |
| Erträge | $ | 58.177 $ | 59.016 $ | 87.580 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 3.378 | 3.590 | 5.132 |
| NIW je Anteil | $ | 17,22 $ | 16,44 $ | 17,06 |
| Investor CHF (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | CHF | 6.908 CHF | 7.269 CHF | 9.066 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 630 | 692 | 824 |
| NIW je Anteil | CHF | 10,96 CHF | 10,50 CHF | 11,00 |
| Investor EUR (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | € | 30.102 € | 31.619 € | 63.525 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 1.439 | 1.581 | 3.046 |
| NIW je Anteil | € | 20,91 € | 19,99 € | 20,85 |
| Investor GBP (Hedged): | | | | |
| thesaurierend | £ | 1.362 £ | 2.555 £ | 4.851 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | | 113 | 222 | 410 |
| NIW je Anteil | £ | 12,09 £ | 11,49 £ | 11,84 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | Total Return Bond Fund (Forts.) | | |
| Administrative: | | | |
| thesaurierend | $ 205.212 | $ 213.762 | $ 303.602 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.206 | 7.965 | 11.139 |
| NIW je Anteil | $ 28,48 | $ 26,83 | $ 27,26 |
| Administrative EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 2.333 | € 2.738 | € 5.233 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 186 | 228 | 418 |
| NIW je Anteil | € 12,54 | € 12,00 | € 12,53 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 553.174 | $ 507.254 | $ 610.867 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 20.196 | 19.613 | 23.162 |
| NIW je Anteil | $ 27,39 | $ 25,86 | $ 26,37 |
| Erträge | $ 217.178 | $ 220.186 | $ 258.052 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 16.807 | 17.850 | 20.153 |
| NIW je Anteil | $ 12,92 | $ 12,33 | $ 12,80 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 4.465 | CHF 5.032 | CHF 5.047 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 451 | 529 | 503 |
| NIW je Anteil | CHF 9,91 | CHF 9,52 | CHF 10,02 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 835.735 | € 878.029 | € 1.146.584 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 42.779 | 46.877 | 58.377 |
| NIW je Anteil | € 19,54 | € 18,73 | € 19,64 |
| Erträge | € 83.070 | € 86.215 | € 115.231 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.640 | 9.250 | 11.580 |
| NIW je Anteil | € 9,61 | € 9,32 | € 9,95 |
| Class E HKD (Unhedged): | | | |
| thesaurierend | HKD 3.306 | HKD 5.848 | HKD 52 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 295 | 552 | 5 |
| NIW je Anteil | HKD 11,20 | HKD 10,59 | HKD 10,79 |
| Class E SGD (Hedged): | | | |
| thesaurierend | SGD 34.855 | SGD 37.144 | SGD 52.904 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 865 | 972 | 1.348 |
| NIW je Anteil | SGD 40,31 | SGD 38,19 | SGD 39,25 |
| Erträge | SGD 1.394 | SGD 1.312 | SGD 1.485 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 137 | 135 | 146 |
| NIW je Anteil | SGD 10,16 | SGD 9,74 | SGD 10,19 |
| G Institutional EUR (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | k. A. | € 71 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | k. A. | 7 |
| NIW je Anteil | k. A. | k. A. | € 10,00 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 30.084 | $ 36.571 | $ 66.363 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.000 | 1.292 | 2.316 |
| NIW je Anteil | $ 30,08 | $ 28,30 | $ 28,65 |
| Erträge | $ 2.637 | $ 599 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 253 | 60 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,41 | $ 9,94 | k. A. |
| M Retail HKD (Unhedged): | | | |
| Erträge | HKD 60.004 | HKD 10.780 | HKD 3.946 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.865 | 1.102 | 389 |
| NIW je Anteil | HKD 10,23 | HKD 9,78 | HKD 10,14 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 2.975 | $ 2.452 | $ 4.539 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 258 | 226 | 413 |
| NIW je Anteil | $ 11,52 | $ 10,84 | $ 10,98 |
| Erträge | $ 2.892 | $ 2.759 | $ 3.977 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 286 | 286 | 397 |
| NIW je Anteil | $ 10,11 | $ 9,65 | $ 10,02 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 10.981 | € 13.002 | € 7.216 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.038 | 1.286 | 685 |
| NIW je Anteil | € 10,57 | € 10,11 | € 10,53 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | Total Return Bond Fund (Forts.) | | |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. £ | 33 £ | 141 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 4 | 14 |
| NIW je Anteil | k. A. £ | 9,40 £ | 9,92 |
| Class T: | | | |
| thesaurierend | $ 5.718 | $ 5.056 | $ 4.925 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 524 | 490 | 467 |
| NIW je Anteil | $ 10,90 | $ 10,31 | $ 10,55 |
| Class T EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 2.405 | € 2.214 | € 3.208 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 238 | 228 | 314 |
| NIW je Anteil | € 10,12 | € 9,72 | € 10,22 |
| | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | | |
| Nettovermögen | $ 30.442 | $ 51.842 | $ 134.029 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 5.374 | $ 3.629 | $ 11.943 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 505 | 346 | 1.139 |
| NIW je Anteil | $ 10,64 | $ 10,49 | $ 10,48 |
| Erträge | $ 11 | $ 10 | $ 73 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 7 |
| NIW je Anteil | $ 10,21 | $ 10,21 | $ 10,34 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | CHF 267 | CHF 4.629 | CHF 12.848 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 28 | 479 | 1.289 |
| NIW je Anteil | CHF 9,64 | CHF 9,66 | CHF 9,97 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 6.927 | € 21.858 | € 44.125 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 703 | 2.217 | 4.362 |
| NIW je Anteil | € 9,85 | € 9,86 | € 10,12 |
| Erträge | € 317 | € 145 | € 7.955 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 34 | 15 | 800 |
| NIW je Anteil | € 9,43 | € 9,56 | € 9,95 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | £ 320 | £ 671 | £ 874 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 32 | 67 | 85 |
| NIW je Anteil | £ 9,86 | £ 9,95 | £ 10,24 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 334 | $ 356 | $ 620 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 32 | 34 | 60 |
| NIW je Anteil | $ 10,49 | $ 10,36 | $ 10,39 |
| Erträge | k. A. | $ 182 | $ 234 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 18 | 23 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,19 | $ 10,33 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. € | 37 € | 38 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 4 | 4 |
| NIW je Anteil | k. A. € | 9,73 € | 10,03 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 5.124 | $ 5.688 | $ 6.320 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 503 | 563 | 619 |
| NIW je Anteil | $ 10,19 | $ 10,10 | $ 10,20 |
| Erträge | $ 102 | $ 119 | $ 334 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10 | 12 | 33 |
| NIW je Anteil | $ 10,06 | $ 10,06 | $ 10,19 |
| Class E CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. CHF | 110 CHF | 115 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 12 | 12 |
| NIW je Anteil | k. A. CHF | 9,30 CHF | 9,70 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (Forts.) | | |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 9.278 | € 9.287 | € 30.690 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 983 | 979 | 3.119 |
| NIW je Anteil | € 9,43 | € 9,49 | € 9,84 |
| Erträge | k. A. | € 157 | € 305 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 17 | 31 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,45 | € 9,83 |
| Class E GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | £ 53 | £ 55 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 5 | 5 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 9,84 | £ 10,13 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 10 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,47 | $ 10,47 |
| Class R EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 38 | € 39 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 4 | 4 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,83 | € 10,10 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | £ 55 | £ 56 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 6 | 5 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 9,95 | £ 10,25 |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | k. A. | $ 11 | $ 11 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 10,72 | $ 10,58 |
| | UK Corporate Bond Fund | | |
| Nettovermögen | £ 425.391 | £ 386.886 | £ 480.675 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | £ 224.844 | £ 195.864 | £ 320.157 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.652 | 9.942 | 15.898 |
| NIW je Anteil | £ 21,11 | £ 19,70 | £ 20,14 |
| Erträge | £ 198.738 | £ 189.355 | £ 159.218 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 19.037 | 19.184 | 15.393 |
| NIW je Anteil | £ 10,44 | £ 9,87 | £ 10,34 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | £ 1.809 | £ 1.659 | £ 1.292 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 157 | 154 | 117 |
| NIW je Anteil | £ 11,53 | £ 10,78 | £ 11,06 |
| Erträge | k. A. | £ 8 | £ 8 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 10,25 | £ 10,74 |
| | UK Long Term Corporate Bond Fund | | |
| Nettovermögen | £ 425.571 | £ 372.630 | £ 434.641 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | £ 297.842 | £ 242.229 | £ 363.219 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 11.891 | 10.679 | 15.475 |
| NIW je Anteil | £ 25,05 | £ 22,68 | £ 23,47 |
| Erträge | £ 127.729 | £ 130.401 | £ 71.422 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.075 | 8.951 | 4.580 |
| NIW je Anteil | £ 15,82 | £ 14,57 | £ 15,59 |
| | US High Yield Bond Fund | | |
| Nettovermögen | $ 2.894.713 | $ 2.496.388 | $ 3.014.320 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 1.268.579 | $ 1.169.729 | $ 1.230.344 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 35.655 | 36.233 | 37.127 |
| NIW je Anteil | $ 35,58 | $ 32,28 | $ 33,14 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| | US High Yield Bond Fund (Forts.) | | |
| Erträge | $ 230.996 | $ 151.035 | $ 147.381 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 23.170 | 16.235 | 14.563 |
| NIW je Anteil | $ 9,97 | $ 9,30 | $ 10,12 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 157.436 | € 125.836 | € 331.120 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.439 | 4.718 | 11.764 |
| NIW je Anteil | € 28,94 | € 26,67 | € 28,14 |
| Erträge | € 315.715 | € 272.909 | € 329.417 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 25.967 | 23.681 | 25.550 |
| NIW je Anteil | € 12,16 | € 11,52 | € 12,89 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| thesaurierend | £ 62.665 | £ 56.623 | £ 52.142 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.885 | 2.841 | 2.507 |
| NIW je Anteil | £ 21,72 | £ 19,93 | £ 20,80 |
| Erträge | £ 40.703 | £ 37.593 | £ 39.172 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.075 | 3.988 | 3.755 |
| NIW je Anteil | £ 9,99 | £ 9,43 | £ 10,43 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 267.656 | $ 217.767 | $ 188.731 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 8.324 | 7.451 | 6.269 |
| NIW je Anteil | $ 32,15 | $ 29,23 | $ 30,10 |
| Erträge | $ 29.680 | $ 20.600 | $ 36.393 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.683 | 2.739 | 4.449 |
| NIW je Anteil | $ 8,06 | $ 7,52 | $ 8,18 |
| Investor EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 3.125 | € 2.394 | € 3.654 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 118 | 98 | 141 |
| NIW je Anteil | € 26,44 | € 24,41 | € 25,84 |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 147.870 | $ 122.146 | $ 141.833 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 4.679 | 4.241 | 4.754 |
| NIW je Anteil | $ 31,60 | $ 28,80 | $ 29,83 |
| Erträge | $ 107.731 | $ 82.015 | $ 71.645 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.134 | 8.267 | 6.639 |
| NIW je Anteil | $ 10,63 | $ 9,92 | $ 10,79 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 86.988 | € 71.026 | € 95.584 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 3.388 | 2.988 | 3.777 |
| NIW je Anteil | € 25,67 | € 23,77 | € 25,30 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 43.131 | $ 29.868 | $ 117.922 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.246 | 950 | 3.647 |
| NIW je Anteil | $ 34,62 | $ 31,44 | $ 32,33 |
| M Retail: | | | |
| Erträge | $ 8.487 | $ 8.762 | $ 12.677 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 788 | 872 | 1.160 |
| NIW je Anteil | $ 10,76 | $ 10,05 | $ 10,93 |
| Class R: | | | |
| thesaurierend | $ 9.269 | $ 9.278 | $ 7.811 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 653 | 719 | 588 |
| NIW je Anteil | $ 14,20 | $ 12,90 | $ 13,27 |
| Erträge | k. A. | $ 895 | $ 1.023 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 95 | 100 |
| NIW je Anteil | k. A. | $ 9,40 | $ 10,23 |
| Class R GBP (Hedged): | | | |
| Erträge | k. A. | £ 1.066 | £ 1.190 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 117 | 118 |
| NIW je Anteil | k. A. | £ 9,08 | £ 10,05 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **US High Yield Bond Fund (Forts.)** | | | |
| Class Z: | | | |
| thesaurierend | $ 8.313 | $ 23.183 | $ 21.086 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 661 | 2.036 | 1.814 |
| NIW je Anteil | $ 12,58 | $ 11,39 | $ 11,62 |
| **US Investment Grade Corporate Bond Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 288.477 | $ 178.732 | $ 159.790 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 83.352 | $ 55.471 | $ 64.316 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 7.268 | 5.348 | 6.047 |
| NIW je Anteil | $ 11,47 | $ 10,37 | $ 10,64 |
| Erträge | $ 56.814 | $ 26.529 | $ 68 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 5.476 | 2.772 | 7 |
| NIW je Anteil | $ 10,38 | $ 9,57 | $ 10,21 |
| Institutional CHF (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | CHF 238 | CHF 264 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 24 | 26 |
| NIW je Anteil | k. A. | CHF 9,70 | CHF 10,28 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 112.711 | € 62.493 | 157 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 10.529 | 6.355 | 15 |
| NIW je Anteil | € 10,70 | € 9,83 | € 10,37 |
| Erträge | k. A. | € 443 | € 9 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 49 | 1 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,07 | € 9,96 |
| Institutional GBP (Hedged): | | | |
| ausschüttend II | £ 15.228 | £ 18.228 | £ 69.272 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.554 | 1.993 | 6.943 |
| NIW je Anteil | £ 9,80 | £ 9,15 | £ 9,98 |
| Class E: | | | |
| Erträge | $ 555 | $ 986 | $ 933 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 53 | 103 | 91 |
| NIW je Anteil | $ 10,53 | $ 9,57 | $ 10,21 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | k. A. | € 186 | € 118 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 19 | 12 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,51 | € 10,13 |
| Erträge | k. A. | € 99 | € 111 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | k. A. | 11 | 11 |
| NIW je Anteil | k. A. | € 9,08 | € 9,97 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 11 | $ 10 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,92 | $ 9,88 | $ 10,15 |
| Erträge | $ 11 | $ 10 | $ 10 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1 | 1 | 1 |
| NIW je Anteil | $ 10,18 | $ 9,39 | $ 10,02 |
| **US Short-Term Fund** | | | |
| Nettovermögen | $ 2.413.061 | $ 2.650.419 | $ 1.372.039 |
| Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 825.823 | $ 813.362 | $ 567.531 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 75.218 | 75.227 | 53.358 |
| NIW je Anteil | $ 10,98 | $ 10,81 | $ 10,64 |
| Institutional EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 362.119 | € 664.894 | € 77.213 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 35.812 | 65.772 | 7.557 |
| NIW je Anteil | € 10,11 | € 10,11 | € 10,22 |
| Investor: | | | |
| thesaurierend | $ 28.945 | $ 34.304 | $ 21.281 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 2.683 | 3.223 | 2.025 |
| NIW je Anteil | $ 10,79 | $ 10,64 | $ 10,51 |

| | Zum 30. Juni 2019 | Zum 31. Dez. 2018 | Zum 31. Dez. 2017 |
|---|---|---|---|
| **US Short-Term Fund (Forts.)** | | | |
| Class E: | | | |
| thesaurierend | $ 417.513 | $ 313.853 | $ 99.870 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 38.755 | 29.525 | 9.513 |
| NIW je Anteil | $ 10,77 | $ 10,63 | $ 10,50 |
| Class E EUR (Hedged): | | | |
| thesaurierend | € 12.429 | € 13.552 | € 3.498 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 1.258 | 1.369 | 348 |
| NIW je Anteil | € 9,88 | € 9,90 | € 10,05 |
| H Institutional: | | | |
| thesaurierend | $ 805 | $ 10 | k. A. |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 79 | 1 | k. A. |
| NIW je Anteil | $ 10,13 | $ 9,99 | k. A. |
| Class Z: | | | |
| Erträge | $ 713.439 | $ 713.324 | $ 586.440 |
| ausgegebene und umlaufende Anteile | 70.719 | 70.784 | 57.846 |
| NIW je Anteil | $ 10,09 | $ 10,08 | $ 10,14 |

## 16. VERGÜTUNG

Die Gesellschaft wendet eine Vergütungspolitik an, die den geltenden OGAW-Anforderungen entspricht und im Verkaufsprospekt zusammengefasst ist.

Nähere Einzelheiten zur Vergütung der Gesellschaft sowie entsprechende finanzielle Angaben werden im geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019 bereitgestellt.

## 17. RECHTSSTREITIGKEITEN UND AUFSICHTSRECHTLICHE ANGELEGENHEITEN

Die Gesellschaft ist nicht als Beklagte an wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schiedsgerichtsverfahren beteiligt und ihr sind etwaige solche gegen sie bestehenden oder drohenden wesentlichen Rechtsstreitigkeiten oder Schadensersatzforderungen nicht bekannt.

Die vorangehenden Ausführungen gelten lediglich zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts.

## 18. KREDITFAZILITÄT

Der Global High Yield Bond Fund und der US High Yield Bond Fund (die „Teilfonds“ bzw. jeweils ein „Teilfonds“) haben am 29. September 2017 eine syndizierte geänderte und neu gefasste Kreditfazilität (die „Fazilität“), geändert durch eine erste Änderungsvereinbarung vom 31. August 2018 mit Wirkung zum 24. August 2018, (die „Kreditvereinbarung“) zwischen u.a. den Teilfonds, bestimmten Kreditgebern, zu denen auch MUFG Bank Ltd. („MUFG“) (als „Kreditgeber“) zählt, und MUFG (als „Agent“ und „Lead Arranger“) abgeschlossen. Jeder Teilfonds darf die Fazilität für temporäre Zwecke nutzen, um Rücknahmen durch Anteilinhaber zu finanzieren, sowie für andere kurzfristige Liquiditätszwecke, die gemäß seiner Anlagepolitik zulässig sind.

Der Gesamtbetrag, der für eine Nutzung durch die Teilfonds zur Verfügung steht, beläuft sich vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung auf USD 341.000.000. Die Teilfonds können zusammen mit den anderen Kreditnehmern (gemeinsam als die „Kreditnehmer“ bezeichnet) und vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarung eine Erhöhung des insgesamt von den Kreditgebern gemäß der Kreditvereinbarung zugesagten Betrags um bis zu USD 160.000.000 beantragen. Dieser erhöhte zugesagte Betrag würde den Kreditnehmern zur Inanspruchnahme gemäß den Bestimmungen der Kreditvereinbarung zur Verfügung stehen.

Die Kreditvereinbarung sieht zwei verschiedene Zinssätze vor. Bei der Inanspruchnahme eines Kredits entscheidet jeder Teilfonds selbst, welcher Zinssatz für das jeweilige Darlehen gilt. Hierbei wird der geltende Zinssatz durch Bezugnahme auf (i) die Alternate Base Rate (alternativer Basiszinssatz) oder (ii) die Adjusted Offered Rate (angepasster Briefkurs) bestimmt. Die Alternate Base Rate liegt 1,125 % 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 1,125 %) und der geltenden Adjusted Offered Rate.

Die für einen Zinszeitraum (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) geltende Adjusted Offered Rate ist ein jährlicher Zinssatz, der dem Quotienten entspricht, der sich ergibt, wenn (a) der LIBOR Offered Rate (LIBOR-Briefkurs) (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) durch (b) 1,00 abzüglich der Reserve Percentage (Reservesatz) (gemäß Definition in der Kreditvereinbarung) geteilt wird.

Ein Kredit, der auf Basis der Alternate Base Rate in Anspruch genommen wird, ist vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarungen innerhalb von 60 Tagen nach Inanspruchnahme zurückzuzahlen. Ein Kredit, der auf Basis der Adjusted Offered Rate in Anspruch genommen wird, ist vorbehaltlich der Bestimmungen der Kreditvereinbarungen am letzten Tag eines maßgeblichen Zinszeitraums (dieser kann nach Wahl eines Teilfonds einem Zeitraum von einer Woche, einem Monat oder zwei Monaten entsprechen) zurückzuzahlen.

Sämtliche Kredite werden auf unbesicherter Basis gewährt, und der Rückgriff der Kreditgeber gegenüber einem Teilfonds ist auf die Vermögenswerte des betreffenden Teilfonds beschränkt.

Zum 30. Juni 2019 und zum 31. Dezember 2018 hatte keiner der Teilfonds im Rahmen der Kreditvereinbarung Kredite in Anspruch genommen.

## 19. VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die Richtlinie über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions Regulation, „SFTR") führt Melde- und Offenlegungspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Securities Financing Transactions, „SFTs") und Total Return Swaps ein. SFTs sind gemäß Artikel 3(11) der SFTR folgendermaßen konkret definiert:

- Pensionsgeschäfte/umgekehrte Pensionsgeschäfte
- Wertpapier- oder Rohstoffleihgeschäfte
- Buy-Sellback- oder Sale-Buyback-Geschäfte
- Lombardgeschäfte

### (a) Globale Daten und Konzentration von SFT-Kontrahenten

Zum 30. Juni 2019 hielten die Teilfonds die folgenden Arten von SFTs und Total Return Swaps:

Der Marktwert von Vermögenswerten/(Verbindlichkeiten) über alle SFTs und Total Return Swaps hinweg, jeweils gruppiert nach SFT-Art(en), und die zehn größten Kontrahenten gestalteten sich zum 30. Juni 2019 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

| Fonds | 30. Juni 2019 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **PIMCO Asia High Yield Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 1.718 | 1,22 |
| **PIMCO Capital Securities Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ (1.068) | (0,01) |
| JPM | 1.665 | 0,02 |
| SOG | 19 | 0,00 |
| **Summe** | 616 | 0,01 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 322.100 | 4,70 |
| FICC | 85.298 | 1,24 |
| JPS | 500.000 | 7,29 |
| SCX | 300.000 | 4,38 |
| **Summe** | 1.207.398 | 17,61 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (2.915) | (0,05) |
| CIW | (18.690) | (0,27) |
| IND | (88.093) | (1,28) |
| JML | (1.182) | (0,02) |
| RDR | (104.091) | (1,51) |
| SCX | (201.929) | (2,95) |
| UBS | (486.437) | (7,09) |
| **Summe** | (903.337) | (13,17) |

| Fonds | 30. Juni 2019 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Commodity Real Return Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ 1.369 | 0,25 |
| CBK | 4.158 | 0,77 |
| CIB | 603 | 0,11 |
| FBF | 302 | 0,06 |
| GST | 2.117 | 0,40 |
| JPM | 3.765 | 0,70 |
| MEI | 558 | 0,10 |
| SOG | 69 | 0,01 |
| **Summe** | 12.941 | 2,40 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 4.800 | 0,89 |
| FICC | 2.133 | 0,40 |
| **Summe** | 6.933 | 1,29 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BSN | (17.603) | (3,27) |
| GRE | (25.216) | (4,69) |
| IND | (24.423) | (4,55) |
| SCX | (119.432) | (22,21) |
| **Summe** | (186.674) | (34,72) |
| **PIMCO Credit Opportunities Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 978 | 0,67 |
| MBC | 11.300 | 7,68 |
| **Summe** | 12.278 | 8,35 |
| **Diversified Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BRC | $ 655 | 0,01 |
| CBK | 227 | 0,00 |
| JPM | 69 | 0,00 |
| **Summe** | 951 | 0,01 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BCY | 733.900 | 8,50 |
| BOS | 265.300 | 3,07 |
| FICC | 51.932 | 0,60 |
| MBC | 67.600 | 0,78 |
| RVM | 25.000 | 0,29 |
| **Summe** | 1.143.732 | 13,24 |
| **Diversified Income Duration Hedged Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BRC | $ 140 | 0,01 |
| CBK | 50 | 0,00 |
| **Summe** | 190 | 0,01 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | 42.900 | 3,13 |
| BPG | 42.200 | 3,07 |
| FICC | 10.086 | 0,73 |
| **Summe** | 95.186 | 6,93 |
| **Dynamic Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 990 | 0,02 |
| NOM | 8.700 | 0,23 |
| RDR | 8.000 | 0,20 |
| **Summe** | 17.690 | 0,45 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| CFR | (5.797) | (0,15) |
| **Dynamic Multi-Asset Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | € 4.512 | 0,33 |
| IND | 62.900 | 4,67 |
| **Summe** | 67.412 | 5,00 |
| **Emerging Asia Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 859 | 2,41 |

| Fonds | 30. Juni 2019 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Emerging Local Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 4.884 | 0,20 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (146.427) | (5,91) |
| BRC | (4.812) | (0,19) |
| JML | (89.132) | (3,60) |
| MBC | (177.475) | (7,18) |
| UBS | (8.133) | (0,33) |
| **Summe** | (425.979) | (17,21) |
| **Emerging Markets Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 869 | 0,02 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BRC | (8.553) | (0,23) |
| JML | (6.842) | (0,18) |
| SGY | (8.126) | (0,22) |
| **Summe** | (23.521) | (0,63) |
| **Emerging Markets Corporate Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 926 | 0,40 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (1.214) | (0,52) |
| **PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 2.592 | 2,02 |
| **Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 187 | 0,27 |
| **Euro Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | € 6.294 | 0,25 |
| RYL | 70.000 | 2,81 |
| **Summe** | 76.294 | 3,06 |
| **Euro Credit Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | € 2.900 | 0,30 |
| FICC | 1.378 | 0,14 |
| **Summe** | 4.278 | 0,44 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| CFR | (2.993) | (0,31) |
| JML | (525) | (0,05) |
| **Summe** | (3.518) | (0,36) |
| **Euro Income Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | € 14.557 | 0,66 |
| RYL | 126.700 | 5,72 |
| **Summe** | 141.257 | 6,38 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (102) | (0,01) |
| CFR | (15.753) | (0,71) |
| **Summe** | (15.855) | (0,72) |
| **Euro Long Average Duration Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | € 7.800 | 2,68 |
| FICC | 159 | 0,05 |
| RYL | 1.700 | 0,58 |
| **Summe** | 9.659 | 3,31 |
| **Euro Low Duration Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | € 837 | 0,25 |
| **Euro Short-Term Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | € 2.112 | 0,30 |
| IND | 41.000 | 5,74 |
| RYL | 11.300 | 1,59 |
| **Summe** | 54.412 | 7,63 |

| Fonds | 30. Juni 2019 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Global Advantage Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BRC | $ (100) | (0,01) |
| GST | (185) | (0,03) |
| JPM | (98) | (0,01) |
| MYC | (147) | (0,02) |
| **Summe** | (530) | (0,07) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 1.055 | 0,13 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (45.455) | (5,67) |
| GRE | (14.289) | (1,79) |
| IND | (59.217) | (7,38) |
| **Summe** | (118.961) | (14,84) |
| **Global Advantage Real Return Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 462 | 0,60 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (3.394) | (4,40) |
| IND | (3.186) | (4,13) |
| SCX | (8.884) | (11,52) |
| **Summe** | (15.464) | (20,05) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPG | (3.067) | (3,98) |
| **Global Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BRC | $ (1.979) | (0,01) |
| GST | (1.360) | (0,01) |
| JPM | (2.361) | (0,02) |
| MYC | (1.338) | (0,01) |
| **Summe** | (7.038) | (0,05) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 6.918 | 0,05 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| CFR | (7.558) | (0,06) |
| IND | (152.185) | (1,09) |
| SCX | (235.675) | (1,69) |
| SGY | (1.112) | (0,01) |
| TDM | (4.017) | (0,03) |
| **Summe** | (400.547) | (2,88) |
| **Global Bond ESG Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | $ 29.400 | 4,34 |
| FICC | 1.638 | 0,24 |
| **Summe** | 31.038 | 4,58 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| GRE | (2.536) | (0,37) |
| SCX | (8.355) | (1,24) |
| **Summe** | (10.891) | (1,61) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPG | (20.682) | (3,05) |
| **Summe** | (20.682) | (3,05) |
| **Global Bond Ex-US Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BRC | $ (72) | (0,01) |
| GST | (722) | (0,07) |
| **Summe** | (794) | (0,08) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 2.304 | 0,24 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (48.816) | (5,04) |
| GRE | (1.821) | (0,19) |
| IND | (59.480) | (6,16) |
| JML | (615) | (0,06) |
| **Summe** | (110.732) | (11,45) |

| Fonds | 30. Juni 2019 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Global Bond Ex-US Fund (Forts.)** | | |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPG | $ (1.485) | (0,15) |
| TDM | (12.674) | (1,31) |
| **Summe** | (14.159) | (1,46) |
| **Global High Yield Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ 166 | 0,00 |
| BPS | 15 | 0,00 |
| BRC | 185 | 0,00 |
| GST | 750 | 0,02 |
| JPM | 2.765 | 0,08 |
| **Summe** | 3.881 | 0,10 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 10.900 | 0,29 |
| FICC | 11.651 | 0,31 |
| JPS | 250.000 | 6,61 |
| RVM | 25.000 | 0,66 |
| SAL | 48.200 | 1,27 |
| **Summe** | 345.751 | 9,14 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BCY | (7.158) | (0,18) |
| BPS | (246) | (0,01) |
| BRC | (19.058) | (0,51) |
| **Summe** | (26.462) | (0,70) |
| **Global Investment Grade Credit Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.390 | 0,01 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (34.122) | (0,17) |
| BRC | (19.233) | (0,10) |
| BSN | (50.179) | (0,25) |
| CFR | (8.203) | (0,04) |
| CIB | (329.056) | (1,65) |
| JPS | (29.680) | (0,15) |
| NXN | (142.446) | (0,72) |
| RCY | (35.995) | (0,18) |
| SBI | (16.688) | (0,08) |
| SCX | (104.273) | (0,52) |
| **Summe** | (769.875) | (3,86) |
| **Global Investment Grade Credit ESG Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | $ 4.300 | 5,83 |
| SSB | 983 | 1,33 |
| **Summe** | 5.283 | 7,16 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (207) | (0,28) |
| **Global Libor Plus Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 3.818 | 0,24 |
| **Global Low Duration Real Return Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.503 | 0,13 |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPG | (599.816) | (53,58) |
| TDM | (19.583) | (1,74) |
| **Summe** | (619.399) | (55,32) |
| **Global Multi-Asset Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (18) | 0,00 |
| BPS | 108 | 0,01 |
| FAR | (8) | 0,00 |
| FBF | 49 | 0,00 |
| GST | (8) | 0,00 |
| JPM | (2.910) | (0,33) |
| MEI | 2 | 0,00 |
| MYI | 3 | 0,00 |
| **Summe** | (2.782) | (0,32) |

| Fonds | 30. Juni 2019 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Global Multi-Asset Fund (Forts.)** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 921 | 0,11 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (10.382) | (1,21) |
| GRE | (3.453) | (0,40) |
| IND | (124.580) | (14,44) |
| **Summe** | (138.415) | (16,05) |
| **Global Real Return Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.845 | 0,09 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (91.886) | (4,37) |
| BPS | (16.789) | (0,80) |
| CIB | (14.690) | (0,70) |
| GRE | (20.778) | (0,99) |
| IND | (140.022) | (6,66) |
| SCX | (133.153) | (6,34) |
| **Summe** | (417.318) | (19,86) |
| **Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ 467 | 0,00 |
| CBK | 1.054 | 0,00 |
| FBF | 411 | 0,00 |
| GST | 2.167 | 0,00 |
| JPM | 7.264 | 0,01 |
| **Summe** | 11.363 | 0,01 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 89.795 | 0,12 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (169.517) | (0,23) |
| BRC | (20.800) | (0,03) |
| BSN | (194.655) | (0,27) |
| CFR | (5.612) | (0,01) |
| CSN | (37.765) | (0,05) |
| FOB | (7.263) | (0,01) |
| JML | (5.974) | (0,01) |
| NOM | (818.154) | (1,11) |
| RCY | (43.021) | (0,06) |
| SGY | (179.049) | (0,24) |
| **Summe** | (1.481.810) | (2,02) |
| **Inflation Strategy Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ 67 | 0,09 |
| BPS | 79 | 0,11 |
| CBK | 6 | 0,00 |
| FAR | 0 | 0,00 |
| GST | 78 | 0,11 |
| JPM | (149) | (0,21) |
| MYI | 35 | 0,05 |
| UBS | (24) | (0,03) |
| **Summe** | 92 | 0,12 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | 640 | 0,90 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (6.277) | (8,82) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| TDM | (1.946) | (2,73) |
| **Low Average Duration Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 2.509 | 0,23 |
| RDR | 5.600 | 0,50 |
| **Summe** | 8.109 | 0,73 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| IND | (170.424) | (15,29) |
| SCX | (64.188) | (5,76) |
| **Summe** | (234.612) | (21,05) |

| Fonds | 30. Juni 2019 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Low Average Duration Fund (Forts.)** | | |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPG | $ (28.721) | (2,58) |
| **Low Duration Global Investment Grade Credit Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.115 | 0,22 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (49.308) | (9,52) |
| RCY | (47.250) | (9,12) |
| **Summe** | (96.558) | (18,64) |
| **Low Duration Income Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 917 | 0,23 |
| MBC | 26.600 | 6,60 |
| TDM | 21.200 | 5,27 |
| **Summe** | 48.717 | 12,10 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BCY | (502) | (0,12) |
| **PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ 1.636 | 0,63 |
| BPS | (71) | (0,02) |
| CBK | (81) | (0,05) |
| FAR | 73 | 0,01 |
| GST | 72 | 0,03 |
| MYI | 1.377 | 0,55 |
| **Summe** | 3.006 | 1,15 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 563 | 0,22 |
| **Mortgage Opportunities Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| JPS | $ (7) | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 1.103 | 0,07 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (357.843) | (21,93) |
| CIB | (39.149) | (2,40) |
| RCY | (55.565) | (3,40) |
| SCX | (283.778) | (17,40) |
| **Summe** | (736.335) | (45,13) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BOS | (7.747) | (0,48) |
| BPG | (9.329) | (0,57) |
| **Summe** | (17.076) | (1,05) |
| **PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| FBF | $ 21 | 0,09 |
| JPM | 285 | 1,17 |
| MEI | 978 | 4,01 |
| **Summe** | 1.284 | 5,27 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 2.500 | 10,26 |
| TDM | 1.900 | 7,80 |
| SSB | 326 | 1,33 |
| **Summe** | 4.726 | 19,39 |
| **PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| JPM | $ 1.214 | 0,65 |
| MEI | 4.935 | 2,66 |
| MYI | 1.515 | 0,82 |
| **Summe** | 7.664 | 4,13 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 1.844 | 0,99 |
| JPS | 29.900 | 16,13 |
| **Summe** | 31.744 | 17,12 |

| Fonds | 30. Juni 2019 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 556 | 0,08 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| MEI | (1.784) | (0,26) |
| **StocksPLUS™ Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ 24.693 | 0,84 |
| BPS | 26.129 | 0,89 |
| BRC | 2.905 | 0,10 |
| CBK | 3.600 | 0,12 |
| FAR | 5.515 | 0,19 |
| GST | 5.515 | 0,19 |
| **Summe** | 68.357 | 2,33 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | 143.900 | 4,92 |
| BPG | 65.100 | 2,22 |
| FICC | 15.894 | 0,54 |
| RVM | 25.000 | 0,85 |
| SAL | 208.200 | 7,12 |
| **Summe** | 458.094 | 15,65 |
| **PIMCO StocksPLUS™ AR Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| GST | $ 29 | 0,54 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | 7 | 0,13 |
| **Strategic Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BRC | $ 1 | 0,00 |
| CBK | 15 | 0,00 |
| FBF | 8 | 0,00 |
| GST | 821 | 0,08 |
| JPM | 44 | 0,01 |
| MYC | 13 | 0,00 |
| **Summe** | 902 | 0,09 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 1.653 | 0,15 |
| **Total Return Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| FBF | $ (68) | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 5.874 | 0,12 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| GRE | (104.434) | (2,14) |
| IND | (139.912) | (2,86) |
| **Summe** | (244.346) | (5,00) |
| **PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 2.900 | 9,53 |
| SSB | 774 | 2,54 |
| **Summe** | 3.674 | 12,07 |
| **UK Corporate Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | £ 1.400 | 0,33 |
| FICC | 394 | 0,09 |
| **Summe** | 1.794 | 0,42 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| CFR | (325) | (0,08) |
| SCX | (27.619) | (6,49) |
| **Summe** | (27.944) | (6,57) |
| **UK Long Term Corporate Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | £ 498 | 0,12 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| IND | (2.577) | (0,61) |
| SCX | (105.932) | (24,89) |
| **Summe** | (108.509) | (25,50) |

| Fonds | 30. Juni 2019 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **US High Yield Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BRC | $ 138 | 0,00 |
| FBF | 174 | 0,01 |
| GST | 1.788 | 0,06 |
| JPM | 750 | 0,02 |
| **Summe** | 2.850 | 0,09 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | 80.000 | 2,77 |
| BSN | 46.100 | 1,59 |
| FICC | 11.609 | 0,40 |
| JPS | 30.000 | 1,04 |
| NOM | 46.100 | 1,59 |
| RDR | 58.900 | 2,04 |
| RVM | 25.000 | 0,86 |
| SGY | 46.100 | 1,59 |
| TDM | 46.100 | 1,59 |
| **Summe** | 389.909 | 13,47 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BCY | (6.737) | (0,24) |
| BRC | (24.968) | (0,86) |
| **Summe** | (31.705) | (1,10) |
| **US Investment Grade Corporate Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| MYC | $ 29 | 0,01 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 705 | 0,24 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (42.975) | (14,90) |
| SCX | (4.047) | (1,40) |
| **Summe** | (47.022) | (16,30) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPG | (7.764) | (2,69) |
| **US Short-Term Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.474 | 0,06 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| FOB | (19.922) | (0,82) |
| RCY | (95.988) | (3,98) |
| **Summe** | (115.910) | (4,80) |

Zum 31. Dezember 2018 hielten die Teilfonds die folgenden Arten von SFTs und Total Return Swaps:

- 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 2018 wie nachfolgend angegeben (wenn weniger als zehn Kontrahenten verwendet werden, sind alle Kontrahenten aufgeführt).

| Fonds | 31. Dez. 2018 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **PIMCO Capital Securities Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ (1.465) | (0,03) |
| JPM | (5.717) | (0,10) |
| SOG | (212) | 0,00 |
| **Summe** | (7.394) | (0,13) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| JPS | 1.400.000 | 23,34 |
| SCX | 389.000 | 6,48 |
| SSB | 17.782 | 0,30 |
| **Summe** | 1.806.782 | 30,12 |

| Fonds | 31. Dez. 2018 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **PIMCO Capital Securities Fund (Forts.)** | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ (146.138) | (2,44) |
| FOB | (136.116) | (2,27) |
| GRE | (246.102) | (4,10) |
| IND | (215.494) | (3,60) |
| JML | (15.118) | (0,25) |
| MEI | (249) | 0,00 |
| RDR | (284.351) | (4,74) |
| **Summe** | (1.043.568) | (17,40) |
| **Commodity Real Return Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BPS | $ (2.657) | (0,51) |
| CBK | (8.568) | (1,64) |
| CIB | (1.142) | (0,22) |
| FBF | (571) | (0,11) |
| GST | (4.054) | (0,78) |
| JPM | (5.599) | (1,07) |
| MEI | (1.266) | (0,24) |
| SOG | (130) | (0,03) |
| **Summe** | (23.987) | (4,60) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 1.647 | 0,32 |
| JPS | 2.900 | 0,55 |
| **Summe** | 4.547 | 0,87 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | $ (80.401) | (15,43) |
| GRE | (130.424) | (25,02) |
| IND | (56.799) | (10,90) |
| SCX | (19.551) | (3,76) |
| **Summe** | (287.175) | (55,11) |
| **PIMCO Credit Opportunities Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 593 | 0,42 |
| MBC | 14.200 | 10,03 |
| **Summe** | 14.793 | 10,45 |
| **Diversified Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| CBK | $ (986) | (0,02) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | 1.000 | 0,02 |
| DEU | 94.200 | 1,38 |
| FICC | 54.094 | 0,79 |
| JPS | 304.800 | 4,47 |
| **Summe** | 454.094 | 6,66 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (6.010) | (0,09) |
| BRC | (4.112) | (0,06) |
| **Summe** | (10.122) | (0,15) |
| **Diversified Income Duration Hedged Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| CBK | $ (203) | (0,02) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 9.017 | 0,71 |
| NOM | 43.800 | 3,44 |
| **Summe** | 52.817 | 4,15 |
| **Dynamic Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 3.914 | 0,13 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| GRE | (9.382) | (0,30) |
| NOM | (5.699) | (0,19) |
| RCY | (204.537) | (6,62) |
| **Summe** | (219.618) | (7,11) |

| Fonds | 31. Dez. 2018 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Dynamic Multi-Asset Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| MEI | € (381) | (0,03) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 134.600 | 11,33 |
| FICC | 16.027 | 1,35 |
| **Summe** | 150.627 | 12,68 |
| **Emerging Asia Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 431 | 1,28 |
| **Emerging Local Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 3.845 | 0,17 |
| **Emerging Markets Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 5.010 | 0,21 |
| **Emerging Markets Corporate Bond Fund** | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ (1.616) | (0,83) |
| SCX | (9.689) | (4,98) |
| **Summe** | (11.305) | (5,81) |
| **Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 622 | 1,20 |
| **Euro Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| MYC | € 23 | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 18.300 | 0,92 |
| FICC | 3.481 | 0,18 |
| **Summe** | 21.781 | 1,10 |
| **Euro Credit Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| MYC | € 33 | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 16.200 | 2,18 |
| FICC | 1.535 | 0,21 |
| **Summe** | 17.735 | 2,39 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (2.686) | (0,36) |
| **Euro Income Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| MYC | € 70 | 0,01 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 7.800 | 0,52 |
| FICC | 3.995 | 0,27 |
| **Summe** | 11.795 | 0,79 |
| **Euro Long Average Duration Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| MYC | € 3 | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 3.600 | 1,42 |
| FICC | 416 | 0,16 |
| **Summe** | 4.016 | 1,58 |
| **Euro Low Duration Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | € 1.600 | 0,51 |
| FICC | 139 | 0,04 |
| **Summe** | 1.739 | 0,55 |
| **Euro Short-Term Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | € 39.300 | 5,07 |
| **Global Advantage Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.120 | 0,15 |

| Fonds | 31. Dez. 2018 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Global Advantage Fund (Forts.)** | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | $ (12.316) | (1,68) |
| BPS | (15.963) | (2,18) |
| GRE | (46.527) | (6,36) |
| IND | (42.782) | (5,85) |
| **Summe** | (117.588) | (16,07) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPS | (7.997) | (1,09) |
| TDM | (3.197) | (0,44) |
| **Summe** | (11.194) | (1,53) |
| **Global Advantage Real Return Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | € 545 | 0,62 |
| TDM | 5.600 | 6,37 |
| **Summe** | 6.145 | 6,99 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| IND | $ (20.551) | (23,39) |
| SCX | (6.701) | (7,63) |
| **Summe** | (27.252) | (31,02) |
| **Global Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 11.348 | 0,10 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (30.469) | (0,28) |
| GRE | (47.471) | (0,44) |
| IND | (79.965) | (0,73) |
| RCY | (273.866) | (2,51) |
| SCX | (105.747) | (0,97) |
| TDM | (3.969) | (0,04) |
| **Summe** | (541.487) | (4,97) |
| **Global Bond ESG Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 7.600 | 1,50 |
| FICC | 2.519 | 0,50 |
| TDM | 15.600 | 3,08 |
| **Summe** | 25.719 | 5,08 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (1.747) | (0,35) |
| BPS | (5.304) | (1,04) |
| GRE | (6.710) | (1,32) |
| SCX | (12.339) | (2,44) |
| **Summe** | (26.100) | (5,15) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPS | (8.875) | (1,75) |
| **Global Bond Ex-US Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 581 | 0,06 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (12.035) | (1,25) |
| BPS | (3.512) | (0,36) |
| GRE | (26.112) | (2,71) |
| IND | (57.878) | (6,01) |
| **Summe** | (99.537) | (10,33) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPS | (20.611) | (2,14) |
| TDM | (6.712) | (0,70) |
| **Summe** | (27.323) | (2,84) |
| **Global High Yield Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (282) | (0,01) |
| CBK | (423) | (0,01) |
| FBF | (238) | (0,01) |
| JPM | (469) | (0,01) |
| **Summe** | (1.412) | (0,04) |

| Fonds | 31. Dez. 2018 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Global High Yield Bond Fund (Forts.)** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.695 | 0,05 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BCY | (19.885) | (0,63) |
| BOS | (30.326) | (0,96) |
| BPS | (250) | (0,01) |
| BRC | (13.438) | (0,42) |
| CFR | (2.485) | (0,08) |
| **Summe** | (66.384) | (2,10) |
| **Global Investment Grade Credit Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 5.563 | 0,03 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (63.349) | (0,37) |
| BRC | (3.900) | (0,02) |
| CFR | (2.949) | (0,02) |
| CIB | (225.794) | (1,31) |
| GRE | (21.348) | (0,12) |
| NOM | (3.328) | (0,02) |
| NXN | (334.754) | (1,94) |
| RCY | (591.952) | (3,44) |
| SCX | (226.065) | (1,31) |
| SGY | (77.655) | (0,45) |
| **Summe** | (1.551.094) | (9,00) |
| **Global Investment Grade Credit ESG Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | $ 6.500 | 15,21 |
| SSB | 577 | 1,35 |
| **Summe** | 7.077 | 16,56 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| SCX | (599) | (1,40) |
| **Global Libor Plus Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 3.820 | 0,37 |
| NOM | 28.100 | 2,70 |
| **Summe** | 31.920 | 3,07 |
| **Global Low Duration Real Return Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 2.261 | 0,20 |
| Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPS | 15.467 | 1,34 |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BPG | (155.730) | (13,49) |
| TDM | (264.712) | (22,94) |
| **Summe** | (420.442) | (36,43) |
| **Global Multi-Asset Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ 26 | 0,00 |
| BPS | 811 | 0,09 |
| FAR | (9) | 0,00 |
| GST | 52 | 0,01 |
| JPM | (18) | 0,00 |
| MEI | (1.901) | (0,22) |
| MYI | 30 | 0,00 |
| **Summe** | (1.009) | (0,12) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (51.351) | (6,03) |
| GRE | (53.121) | (6,25) |
| IND | (18.591) | (2,19) |
| RCY | (11.130) | (1,31) |
| SCX | (136.568) | (16,06) |
| **Summe** | (270.761) | (31,84) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| MSC | (2.496) | (0,29) |

| Fonds | 31. Dez. 2018 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Global Real Return Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 1.314 | 0,07 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (138.170) | (7,09) |
| GRE | (171.166) | (8,79) |
| IND | (111.727) | (5,74) |
| SCX | (128.364) | (6,59) |
| **Summe** | (549.427) | (28,21) |
| **Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| FBF | $ (1.583) | 0,00 |
| GST | (4.495) | (0,01) |
| JPM | (4.273) | (0,01) |
| SOG | (1.314) | 0,00 |
| **Summe** | (11.665) | (0,02) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOM | (1.290.081) | (2,30) |
| BOS | (689.194) | (1,23) |
| BSN | (188.544) | (0,34) |
| CIB | (1.537.275) | (2,74) |
| DEU | (151.931) | (0,27) |
| GRE | (258.475) | (0,47) |
| IND | (98.180) | (0,18) |
| JPS | (584.093) | (1,04) |
| RCY | (3.613.785) | (6,48) |
| SCX | (2.321.719) | (4,15) |
| **Summe** | (10.733.277) | (19,20) |
| **Inflation Strategy Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (471) | (0,62) |
| BPS | (74) | (0,09) |
| CBK | (242) | (0,32) |
| DUB | 188 | 0,25 |
| FAR | (3) | 0,00 |
| GST | (48) | (0,07) |
| JPM | (122) | (0,16) |
| MYI | (247) | (0,33) |
| **Summe** | (1.019) | (1,34) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | 631 | 0,83 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (13.800) | (18,12) |
| GRE | (4.530) | (5,94) |
| **Summe** | (18.330) | (24,06) |
| **Low Average Duration Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 609 | 0,05 |
| MBC | 17.300 | 1,42 |
| **Summe** | 17.909 | 1,47 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| IND | (202.941) | (16,62) |
| SCX | (9.716) | 0,79 |
| **Summe** | (212.657) | (17,41) |
| **Low Duration Global Investment Grade Credit Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 843 | 0,16 |
| JPS | 9.000 | 1,71 |
| **Summe** | 9.843 | 1,87 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (8.399) | (1,60) |
| GRE | (28.553) | (5,42) |
| **Summe** | (36.952) | (7,02) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| TDM | (2.702) | (0,51) |

| Fonds | 31. Dez. 2018 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **Low Duration Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| MYC | $ (165) | (0,04) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | 11.600 | 3,07 |
| FICC | 683 | 0,18 |
| TDM | 8.800 | 2,33 |
| **Summe** | 21.083 | 5,58 |
| **PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (8.672) | (3,51) |
| BPS | (59) | (0,03) |
| CBK | (95) | (0,05) |
| FAR | (296) | (0,12) |
| GST | (203) | (0,08) |
| MYI | (1.085) | (0,44) |
| **Summe** | (10.410) | (4,23) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 946 | 0,38 |
| **Mortgage Opportunities Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| JPS | $ (19) | 0,00 |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 782 | 0,04 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (375.544) | (17,20) |
| RCY | (49.442) | (2,27) |
| SCX | (114.780) | (5,26) |
| **Summe** | (539.766) | (24,73) |
| **PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| FBF | $ (5) | (0,02) |
| JPM | (48) | (0,14) |
| MEI | (41) | (0,12) |
| **Summe** | (94) | (0,28) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | 140 | 0,42 |
| **PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| DUB | $ (1.343) | (0,62) |
| JPM | (1.399) | (0,64) |
| SOG | (1.468) | (0,67) |
| **Summe** | (4.210) | (1,93) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 2.876 | 1,33 |
| JPS | 4.600 | 2,11 |
| **Summe** | 7.476 | 3,44 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| GRE | (46.283) | (21,27) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| MSC | (23.642) | (10,87) |
| **PIMCO RAE PLUS US Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (727) | (0,59) |
| CBK | (5) | (0,01) |
| DUB | (461) | (0,37) |
| JPM | (131) | (0,10) |
| **Summe** | (1.324) | (1,07) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 474 | 0,39 |
| JPS | 4.200 | 3,39 |
| **Summe** | 4.674 | 3,78 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| GRE | (6.743) | (5,45) |
| **Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 242 | 0,05 |

| Fonds | 31. Dez. 2018 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **StocksPLUS™ Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (47.130) | (2,05) |
| BPS | (27.314) | (1,19) |
| CBK | (6.554) | (0,28) |
| FAR | (19.362) | (0,84) |
| GST | (16.275) | (0,71) |
| UAG | (8.707) | (0,38) |
| **Summe** | (125.342) | (5,45) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 13.409 | 0,58 |
| MFK | 50.000 | 2,18 |
| SAL | 116.300 | 5,06 |
| **Summe** | 179.709 | 7,82 |
| **Strategic Income Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| CBK | $ (8) | 0,00 |
| FBF | (11) | 0,00 |
| GST | (418) | (0,05) |
| JPM | (32) | 0,00 |
| MYC | (2) | 0,00 |
| **Summe** | (471) | (0,05) |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (47.179) | (5,25) |
| GRE | (9.363) | (1,04) |
| **Summe** | (56.542) | (6,29) |
| Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | | |
| BOS | (2.465) | (0,27) |
| MSC | (2.850) | (0,32) |
| **Summe** | (5.315) | (0,59) |
| **Total Return Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| FBF | $ (251) | (0,01) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 31.157 | 0,64 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (50.187) | (1,02) |
| IND | (290.517) | (5,93) |
| **Summe** | (340.704) | (6,95) |
| **PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| SSB | $ 1.891 | 3,65 |
| **UK Corporate Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | £ 322 | 0,08 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| SCX | (27.358) | (7,07) |
| **UK Long Term Corporate Bond Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | £ 335 | 0,09 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BPS | (439) | (0,12) |
| IND | (38.799) | (10,41) |
| SCX | (51.298) | (13,77) |
| **Summe** | (90.536) | (24,30) |
| **US High Yield Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| BOA | $ (83) | 0,00 |
| CBK | (409) | (0,02) |
| GST | (528) | (0,02) |
| JPM | (218) | (0,01) |
| **Summe** | (1.238) | (0,05) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| AZD | 6.200 | 0,25 |
| FICC | 6.047 | 0,24 |
| MFK | 150.000 | 6,01 |
| **Summe** | 162.247 | 6,50 |

| Fonds | 31. Dez. 2018 Marktwert (000S) | % des Nettover-mögens |
|---|---|---|
| **US High Yield Bond Fund (Forts.)** | | |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BCY | $ (21.147) | (0,85) |
| BOS | (22.738) | (0,91) |
| BRC | (32.900) | (1,32) |
| **Summe** | (76.785) | (3,08) |
| **US Investment Grade Corporate Bond Fund** | | |
| Total Return Swaps | | |
| GST | $ (27) | (0,01) |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | 449 | 0,25 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (23.491) | (13,15) |
| SCX | (24.918) | (13,93) |
| **Summe** | (48.409) | (27,08) |
| **US Short-Term Fund** | | |
| Pensionsgeschäfte | | |
| FICC | $ 311 | 0,01 |
| Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | |
| BOS | (335.869) | (12,67) |
| DEU | (232.075) | (8,76) |
| GRE | (15.115) | (0,57) |
| RCY | (95.862) | (3,62) |
| **Summe** | (678.921) | (25,62) |

**(b) Sicherheiten**

**(i) Verwahrung erhaltener Sicherheiten:**
Die zum 30. Juni 2019 und zum 31. Dezember 2018 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 und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 30. Juni 2019 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

| Fonds | Sicherheitenemittent | Marktwert (000S) |
|---|---|---|
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ 1.755 |
| PIMCO Capital Securities Fund | Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. | 2.605 |
| | Goldman Sachs Group, Inc. | 3.612 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.237.133 |
| | Vodafone Group PLC | 5.186 |
| Commodity Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 7.085 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 12.671 |
| Diversified Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.170.821 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 97.255 |
| Dynamic Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 18.082 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | ABN AMRO Bank NV | € 50.839 |
| | Santander UK PLC | 10.770 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 4.604 |
| Emerging Asia Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ 880 |
| Emerging Local Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 5.265 |
| Emerging Markets Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 887 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 945 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 2.645 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 192 |
| Euro Bond Fund | Germany Government | € 70.315 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 6.422 |
| Euro Credit Fund | SNCF Reseau | € 2.815 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.406 |
| Euro Income Bond Fund | Europäische Investitionsbank | 66.695 |
| | Germany Government | 19.588 |
| | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | 41.094 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 14.849 |
| Euro Long Average Duration Fund | Germany Government | 1.708 |
| | SNCF Reseau | 7.705 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 165 |
| Euro Low Duration Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 854 |
| Euro Short-Term Fund | Germany Government | 11.350 |
| | Santander UK PLC | 40.916 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 2.155 |
| Global Advantage Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ 1.077 |
| Global Advantage Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 475 |
| Global Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 7.059 |
| | Europäische Investitionsbank | 494 |
| Global Bond ESG Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 31.708 |
| Global Bond Ex-US Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 2.351 |
| Global High Yield Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 353.695 |
| Global Investment Grade Credit Fund | Europäische Investitionsbank | 829 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 19.131 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 5.401 |
| Global Libor Plus Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 3.898 |
| Global Low Duration Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.535 |
| Global Multi-Asset Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 942 |
| Global Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 3.726 |
| Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 94.686 |
| Inflation Strategy Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 658 |
| Low Average Duration Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 8.284 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.401 |
| Low Duration Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 50.164 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 574 |
| Mortgage Opportunities Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 3.428 |
| PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 4.858 |
| PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 32.402 |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 567 |
| StocksPLUS™ Fund | Ginnie Mae | 67.158 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 402.180 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 10 |
| Strategic Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.687 |
| Total Return Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 5.992 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 3.759 |
| UK Corporate Bond Fund | United Kingdom Government | £ 1.397 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 402 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 509 |
| US High Yield Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | $ 398.973 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.060 |
| US Short-Term Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 2.082 |

Die zehn größten Emittenten von Wertpapieren, die als Sicherheiten über sämtliche SFTs und Total Return Swaps hinweg erhalten wurden, gestalteten sich zum 31. Dezember 2018 wie folgt. Wenn weniger als zehn Emittenten vorliegen, sind alle Emittenten nachfolgend aufgeführt:

| | Zum 31. Dez. 2018 | |
|---|---|---|
| **Fonds** | **Sicherheitenemittent** | **Marktwert (000S)** |
| PIMCO Capital Securities Fund | Royal Bank of Scotland Plc | 1.499 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.844.823 |
| Commodity Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 4.644 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 15.239 |
| Diversified Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 464.339 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 54.068 |
| Dynamic Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 6.082 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | German Government | 134.703 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 16.351 |
| Emerging Asia Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 442 |
| Emerging Local Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 3.925 |
| Emerging Markets Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 5.115 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 635 |
| Euro Bond Fund | Regierung von Österreich | 18.338 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 3.554 |
| Euro Credit Fund | Regierung von Österreich | 16.234 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.567 |
| Euro Income Bond Fund | Regierung von Österreich | 7.816 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 4.077 |
| Euro Long Average Duration Fund | Regierung von Österreich | 3.607 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 429 |
| Euro Low Duration Fund | Regierung von Österreich | 1.611 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 143 |
| Euro Short-Term Fund | Germany Government | 39.330 |
| Global Advantage Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.143 |
| Global Advantage Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 6.292 |
| Global Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 15.040 |
| Global Bond ESG Fund | Ginnie Mae | 7.864 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 18.600 |
| Global Bond Ex-US Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 851 |
| Global High Yield Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.730 |
| Global Investment Grade Credit Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 47.455 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 7.242 |
| Global Libor Plus Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 32.687 |
| Global Low Duration Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 2.307 |
| Global Multi-Asset Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 512 |
| Global Real Return Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 2.462 |
| Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 104.879 |
| Inflation Strategy Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 645 |
| Low Average Duration Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 18.535 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 10.047 |
| Low Duration Income Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 21.604 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 970 |
| Mortgage Opportunities Fund | Fannie Mae | 197 |
| | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 3.229 |
| PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 144 |
| PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 7.630 |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 250 |
| StocksPLUS™ Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 183.641 |
| Total Return Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 31.785 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.931 |
| UK Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 329 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 345 |
| US High Yield Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 165.765 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 748 |
| US Short-Term Fund | Regierung der Vereinigten Staaten von Amerika | 1.875 |

ISDA-Vereinbarungen decken eine Kombination von Swap-Kontrakten ab, und der Gesamtbetrag der Sicherheiten für diese Vereinbarungen ist in den obigen Angaben enthalten.

Ein Teil der angegebenen Sicherheiten bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

**iii) Aggregierte Transaktionsdaten:**
Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, sehen zum 30. Juni 2019 wie folgt aus:

| 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 | $ 1.755 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO Capital Securities Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 830 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 328.820 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 307.374 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 87.007 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 511.430 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.502 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. | Unternehmensanleihen | 2.605 | B- | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Goldman Sachs Group, Inc. | Unternehmensanleihen | 3.612 | BBB+ | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Vodafone Group PLC | Unternehmensanleihen | 5.186 | BBB+ | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 260 | k. A. | k. A. | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 722 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 6.269 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Marktwert (000S) | Qualität | Fälligkeits-profil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Commodity Real Return Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 2.178 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 4.907 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 600 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.137 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 11.673 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 998 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 140 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Diversified Income Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 640 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 273.227 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 844.619 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 52.975 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 3.210 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 170 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 43.899 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 10.291 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 43.065 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| Dynamic Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 8.897 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Japan | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 8.172 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.013 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 145 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Pensionsgeschäfte | ABN AMRO Bank NV | Unternehmen-sanleihen | 50.839 | A | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Santander UK PLC | Unternehmen-sanleihen | 10.770 | A | Mehr als 1 Jahr | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 4.604 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Asia Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 880 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Local Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 4.985 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 280 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.280 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.172 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 887 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 945 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.645 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 192 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Bond Fund | Pensionsgeschäfte | Bundesrepublik Deutschland | Treasury | € 70.315 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 6.422 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Credit Fund | Pensionsgeschäfte | SNCF Reseau | Unternehmen-sanleihen | 2.815 | AA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.406 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Income Bond Fund | Pensionsgeschäfte | Europäische Investitionsbank | Supranational | 66.247 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Bundesrepublik Deutschland | Treasury | 19.588 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | Unternehmen-sanleihen | 41.094 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 14.849 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Europäische Investitionsbank | Supranational | 448 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Schweiz | FED, Bilateral |
| Euro Long Average Duration Fund | Pensionsgeschäfte | Bundesrepublik Deutschland | Treasury | 1.708 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | SNCF Reseau | Unternehmen-sanleihen | 7.705 | AA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 165 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 237 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| Euro Low Duration Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 854 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Marktwert (000S) | Qualität | Fälligkeits-profil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Euro Short-Term Fund | Pensionsgeschäfte | Bundesrepublik Deutschland | Treasury | € 11.350 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Santander UK PLC | Unternehmen-sanleihen | 40.916 | A | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.155 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Advantage Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | $ 1.140 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 560 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.077 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 2.224 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.580 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global Advantage Real Return Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 475 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 338 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global Bond Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 8.560 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 7.059 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Europäische Investitionsbank | Supranational | 494 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Schweiz | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 2.410 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| Global Bond ESG Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 30.036 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.672 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Bond Ex-US Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 370 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.351 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 4.565 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 24 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global High Yield Bond Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.870 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 3.980 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 255.075 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 25.518 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 61.115 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 11.144 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 291 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 206 | AAA | 3 Monate - 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 346 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global Investment Grade Credit Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.418 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Europäische Investitionsbank | Supranational | 829 | AAA | Mehr als 1 Jahr | EUR | Schweiz | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 4.619 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 641 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 10.716 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.737 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 26.881 | k. A. | k. A. | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 8.548 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 290 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 4.394 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.007 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Libor Plus Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 3.898 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Low Duration Real Return Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.535 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Multi-Asset Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 380 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 2.420 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 942 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 2.046 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.230 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global Real Return Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.884 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 1.759 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 83 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 7.231 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 5.584 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Marktwert (000S) | Qualität | Fälligkeits-profil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Income Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | $ 5.020 | k. A. | k. A. | USD | Schweiz | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 148.280 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 91.594 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 243 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 283 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 1.000 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 1.567 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 13.059 | k. A. | k. A. | USD | Japan | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 520 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Inflation Strategy Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 658 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Low Average Duration Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 5.721 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.563 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 231 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 983 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.138 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 263 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| Low Duration Income Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 27.493 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 938 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 21.733 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 1.460 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 574 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Mortgage Opportunities Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.131 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 2.297 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 260 | k. A. | k. A. | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 4.212 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 1.150 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 1.968 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 334 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 2.556 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 7.340 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 32.402 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 50 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 567 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| StocksPLUS™ Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 23.430 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 2.640 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 32.380 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | Ginnie Mae | Mortgage Pass Thru | 67.158 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 25.536 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 376.644 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 10 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Strategic Income Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 1.270 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.687 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Total Return Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 5.992 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 3.534 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 4.281 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Marktwert (000S) | Qualität | Fälligkeits-profil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | $ 2.965 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 794 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| UK Corporate Bond Fund | Pensionsgeschäfte | United Kingdom Gilt | Treasury | £ 1.397 | AAA | Mehr als 1 Jahr | GBP | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 402 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 1.171 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 509 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 3.147 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| US High Yield Bond Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | $ 3.380 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 2.520 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 107.259 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 47.061 | AAA | 3 Monate - 1 Jahr | USD | Japan | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 25.539 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 269 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 82.172 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 89.515 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 47.157 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 722 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 338 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| US Short-Term Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.504 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 578 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |

Die aggregierten Transaktionsdaten für Sicherheitenpositionen (einschließlich von Barmitteln), die über sämtliche SFTs hinweg erhalten wurden, sehen zum 31. Dezember 2018 wie folgt aus:

| Fonds | Wertpapierart | Beschreibung der Sicherheiten | Art der Sicherheiten | Marktwert (000S) | Qualität | Fälligkeits-profil der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Gründungsland des Kontrahenten | Abrechnung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| PIMCO Capital Securities Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | $ 100.792 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 296.357 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 153.433 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 273.650 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 1.020.591 | AAA | 3 Monate - 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Royal Bank of Scotland Plc | Unternehmen-sanleihen | 1.499 | BBB- | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 3.405 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 1.081 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 1.900 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Commodity Real Return Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 4.644 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 1.380 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 4.730 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 14.632 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 607 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 140 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Diversified Income Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 96.799 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Deutschland | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 1.034 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 366.506 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 44.870 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Japan | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 9.198 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Dynamic Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 3.997 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.085 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | 145 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Dynamic Multi-Asset Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungs-mittel | € 340 | k. A. | k. A. | EUR | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | Bundesrepublik Deutschland | Treasury | 134.703 | AAA | 3 Monate - 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 16.351 | 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 Asia Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 442 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Local Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 3.925 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 5.115 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 635 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Bond Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | € 1.220 | k. A. | k. A. | EUR | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | Republik Österreich | Treasury | 18.338 | AA+ | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 3.554 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Credit Fund | Pensionsgeschäfte | Republik Österreich | Treasury | 16.234 | AA+ | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.567 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Income Bond Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 131 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | Republik Österreich | Treasury | 7.816 | AA+ | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 4.077 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Long Average Duration Fund | Pensionsgeschäfte | Republik Österreich | Treasury | 3.607 | AA+ | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 429 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Low Duration Fund | Pensionsgeschäfte | Republik Österreich | Treasury | 1.611 | AA+ | Mehr als 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 143 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Euro Short-Term Fund | Pensionsgeschäfte | Bundesrepublik Deutschland | Treasury | 39.330 | AAA | 3 Monate - 1 Jahr | EUR | Frankreich | FED, Bilateral |
| Global Advantage Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 1.143 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 910 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 30 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global Advantage Real Return Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 6.292 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.500 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| Global Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 11.577 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.666 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 797 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.052 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 3.868 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global Bond ESG Fund | Pensionsgeschäfte | Ginnie Mae | Mortgage Pass Thru | 7.864 | AA+ | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 18.600 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 260 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global Bond Ex-US Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 597 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 254 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.074 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 587 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global High Yield Bond Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 580 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.730 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Investment Grade Credit Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 5.674 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 27.554 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 13.775 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 452 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 8.430 | k. A. | k. A. | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 3.567 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 6.651 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 591 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Libor Plus Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 28.787 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Japan | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 3.900 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Low Duration Real Return Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.307 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Global Multi-Asset Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.060 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 630 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 265 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 247 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.830 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 2.182 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Global Real Return Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 1.342 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 1.084 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.665 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 2.581 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| Income Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 72.110 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 392 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 2.232 | AAA | 3 Monate - 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 82.346 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.625 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Deutschland | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 10.095 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 8.189 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 31.099 | k. A. | k. A. | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 700 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 28.597 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 990 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Inflation Strategy Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 770 | k. A. | k. A. | USD | Deutschland | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 645 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Low Average Duration Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 17.912 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 623 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 929 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 10.047 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Low Duration Income Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 260 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Inflation Protected Securities | Treasury | 11.861 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 9.743 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 970 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Mortgage Opportunities Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 801 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Fannie Mae | Mortgage Pass Thru | 197 | AA+ | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 587 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 1.841 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.626 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 144 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 4.180 | k. A. | k. A. | USD | Deutschland | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 7.630 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 320 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| PIMCO RAE PLUS US Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.600 | k. A. | k. A. | USD | Deutschland | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 4.771 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 250 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| StocksPLUS™ Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 51.087 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Portugal | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 132.554 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| Total Return Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 31.785 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 1.740 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 1.931 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| UK Corporate Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | £ 329 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 609 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 345 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 869 | k. A. | k. A. | USD | Frankreich | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 963 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| US High Yield Bond Fund | Swap-Kontrakte | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | $ 330 | k. A. | k. A. | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 6.333 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Australien | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 153.261 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Portugal | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 6.171 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | $ 459 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 289 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | | Barsicherheiten | Zahlungsmittel | 320 | k. A. | k. A. | USD | Großbritannien | FED, Bilateral |
| US Short-Term Fund | Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 322 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Vereinigte Staaten | FED, Bilateral |
| | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | U.S. Treasury Notes | Treasury | 255 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Kanada | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Notes | Treasury | 335 | AAA | Mehr als 1 Jahr | USD | Deutschland | FED, Bilateral |
| | | U.S. Treasury Bonds | Treasury | 963 | AAA | Mehr als 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 30. Juni 2019 und zum 31. Dezember 2018 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.

**(iv) Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten:**
Als Sicherheiten erhaltene Wertpapiere wurden zum 30. Juni 2019 und zum 31. Dezember 2018 nicht wiederverwendet.

Barsicherheiten gehen im Depotkonto der Fonds ein und werden somit nicht individuell verfolgt, um zu ermitteln, ob sie wiederverwendet werden. Somit kann nicht angemessen geprüft werden, in welchem Umfang Barsicherheiten wiederverwendet werden.

Die zum 30. Juni 2019 erhaltenen Sicherheiten wurden im Depotbanknetz der State Street Bank and Trust gehalten.

**v) Verwahrung gestellter Sicherheiten:**
Die von den Teilfonds zum 30. Juni 2019 und zum 31. Dezember 2018 verpfändeten Sicherheiten werden von den Kontrahenten in Konten gehalten, bei denen es sich nicht um getrennte oder Sammelkonten handelt.

**(c) Rendite/Kosten**
Die nachfolgenden Tabellen liefern detaillierte Angaben zur Rendite und den Kosten jeder Art von SFT und Total Return Swap für die Berichtszeiträume zum 30. Juni 2019 und zum 30. Juni 2018. Die Beträge sind in der Basiswährung des Fonds ausgewiesen.

| | 30. Juni 2019 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Pensionsgeschäfte | | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte | | Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | |
| Fonds | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) |
| PIMCO Asia High Yield Bond Fund | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| PIMCO Capital Securities Fund | 11.088 | 0 | 80 | 12.357 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Commodity Real Return Fund | 60 | 0 | 0 | 2.630 | 0 | 1 | 0 | 19 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 151 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 1 | 1 |
| Diversified Income Fund | 4.961 | 7 | 22 | 34 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 571 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dynamic Bond Fund | 2.346 | 0 | 0 | 545 | 0 | 0 | 0 | 1 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | € 89 | € 133 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 |
| Emerging Asia Bond Fund | $ 3 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| Emerging Local Bond Fund | 139 | 0 | 0 | 923 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Emerging Markets Bond Fund | 82 | 0 | 3 | 91 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 3 | 0 | 0 | 75 | 0 | 0 | 0 | 19 |
| PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | 59 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Bond Fund | € 25 | € 155 | € 11 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 |
| Euro Credit Fund | 0 | 18 | 44 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Income Bond Fund | 44 | 148 | 152 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Long Average Duration Fund | 0 | 10 | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Low Duration Fund | 2 | 8 | 3 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Short-Term Fund | 3 | 62 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Global Advantage Fund | $ 1 | $ 0 | $ 60 | $ 782 | $ 0 | $ 13 | $ 0 | $ 61 |
| Global Advantage Real Return Fund | 17 | 0 | 8 | 201 | 0 | 0 | 0 | 32 |
| Global Bond Fund | 778 | 0 | 21 | 1.245 | 0 | 0 | 0 | 24 |
| Global Bond ESG Fund | 334 | 0 | 5 | 50 | 0 | 0 | 0 | 77 |
| Global Bond Ex-US Fund | 0 | 0 | 43 | 493 | 0 | 0 | 0 | 155 |
| Global High Yield Bond Fund | 2.887 | 0 | 27 | 267 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 1.417 | 0 | 264 | 11.592 | 0 | 20 | 40 | 1.296 |
| Global Investment Grade Credit ESG Fund | 23 | 0 | 0 | 5 | 15 | 0 | 0 | 2 |
| Global Libor Plus Bond Fund | 1.181 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 5.465 | 0 | 0 | 0 | 0 | 767 | 0 | 0 |
| Global Multi-Asset Fund | 22 | 0 | 19 | 1.723 | 0 | 1 | 0 | 62 |
| Global Real Return Fund | 4 | 0 | 30 | 6.408 | 0 | 3 | 0 | 93 |
| Income Fund | 1.866 | 0 | 791 | 82.494 | 0 | 6 | 56 | 517 |
| Inflation Strategy Fund | 8 | 0 | 0 | 130 | 0 | 0 | 0 | 54 |
| Low Average Duration Fund | 139 | 0 | 0 | 3.518 | 0 | 3 | 0 | 98 |

**30. Juni 2019**

| Fonds | Pensionsgeschäfte Renditen (000S) | Pensionsgeschäfte Kosten (000S) | Umgekehrte Pensionsgeschäfte Renditen (000S) | Umgekehrte Pensionsgeschäfte Kosten (000S) | Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte Renditen (000S) | Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte Kosten (000S) | Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte Renditen (000S) | Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte Kosten (000S) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | $ 1 | $ 0 | $ 0 | $ 548 | $ 0 | $ 1 | $ 0 | $ 246 |
| Low Duration Income Fund | 491 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Mortgage Opportunities Fund | 24 | 0 | 0 | 7.836 | 0 | 4 | 0 | 1.044 |
| PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | 46 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 2 |
| PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | 47 | 0 | 0 | 261 | 0 | 0 | 0 | 153 |
| PIMCO RAE PLUS US Fund | 30 | 0 | 0 | 8 | 0 | 0 | 0 | 5 |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 21 | 0 | 0 | 78 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| StocksPLUS™ Fund | 5.568 | 0 | 0 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO StocksPLUS™ AR Fund | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Strategic Income Fund | 14 | 0 | 0 | 155 | 0 | 3 | 0 | 41 |
| Total Return Bond Fund | 187 | 0 | 0 | 3.243 | 0 | 0 | 0 | 364 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 26 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| UK Corporate Bond Fund | £ 6 | £ 0 | £ 2 | £ 153 | £ 0 | £ 0 | £ 0 | £ 0 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 5 | 0 | 2 | 551 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| US High Yield Bond Fund | $ 3.796 | $ 0 | $ 23 | $ 410 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 0 | 0 | 0 | 343 | 33 | 0 | 3 | 258 |
| US Short-Term Fund | 2.057 | 0 | 0 | 355 | 0 | 9 | 0 | 0 |

**30. Juni 2018**

| Fonds | Pensionsgeschäfte Renditen (000S) | Pensionsgeschäfte Kosten (000S) | Umgekehrte Pensionsgeschäfte Renditen (000S) | Umgekehrte Pensionsgeschäfte Kosten (000S) | Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte Renditen (000S) | Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte Kosten (000S) | Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte Renditen (000S) | Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte Kosten (000S) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| PIMCO Capital Securities Fund | $ 7.456 | $ 93 | $ 11 | $ 7.025 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| Commodity Real Return Fund | 32 | 0 | 4 | 469 | 0 | 0 | 0 | 60 |
| PIMCO Credit Opportunities Bond Fund | 17 | 0 | 0 | 250 | 0 | 0 | 0 | 68 |
| Diversified Income Fund | 1.340 | 225 | 49 | 23 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Diversified Income Duration Hedged Fund | 415 | 69 | 10 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Dynamic Bond Fund | € 84 | € 0 | € 0 | € 2.498 | € 0 | € 0 | € 0 | € 896 |
| Dynamic Multi-Asset Fund | $ 17 | $ 329 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| Emerging Asia Bond Fund | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Emerging Local Bond Fund | 353 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Emerging Markets Bond Fund | 17 | 0 | 8 | 13 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Emerging Markets Corporate Bond Fund | 3 | 0 | 0 | 101 | 0 | 0 | 0 | 18 |
| Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund | € 98 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 | € 0 |
| Euro Bond Fund | 6 | 63 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Credit Fund | 3 | 16 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Income Bond Fund | 5 | 77 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Long Average Duration Fund | 1 | 16 | 4 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Euro Low Duration Fund | 2 | 31 | 34 | 0 | 0 | 0 | 1 | 0 |
| Euro Short-Term Fund | $ 0 | $ 39 | $ 73 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | $ 0 |
| Global Advantage Fund | 6 | 0 | 19 | 379 | 0 | 0 | 0 | 72 |
| Global Advantage Real Return Fund | 2 | 0 | 5 | 230 | 0 | 0 | 0 | 38 |
| Global Bond ESG Fund | 554 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Global Bond Fund | 71 | 63 | 301 | 695 | 0 | 0 | 0 | 10 |
| Global Bond Ex-US Fund | 5 | 0 | 35 | 281 | 0 | 0 | 0 | 28 |
| Global High Yield Bond Fund | 96 | 0 | 64 | 15 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Global Investment Grade Credit Fund | 740 | 0 | 41 | 10.876 | 0 | 0 | 203 | 456 |
| Global Libor Plus Bond Fund | 264 | 0 | 0 | 6 | 0 | 0 | 1 | 23 |
| Global Low Duration Real Return Fund | 11 | 0 | 0 | 222 | 0 | 0 | 0 | 3.410 |
| Global Multi-Asset Fund | 11 | 0 | 0 | 937 | 0 | 0 | 0 | 85 |
| Global Real Return Fund | 9 | 0 | 94 | 5.522 | 0 | 0 | 0 | 360 |
| Income Fund | 1.619 | 0 | 13 | 34.783 | 0 | 0 | 0 | 1.508 |
| Inflation Strategy Fund | 2 | 0 | 0 | 21 | 0 | 0 | 0 | 39 |
| Low Average Duration Fund | 444 | 0 | 0 | 249 | 0 | 0 | 0 | 23 |
| Low Duration Global Investment Grade Credit Fund | 6 | 0 | 0 | 292 | 0 | 0 | 0 | 289 |
| PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund | 16 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund | 74 | 0 | 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 4 |
| PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund | 42 | 0 | 0 | 529 | 0 | 0 | 0 | 254 |
| PIMCO RAE PLUS US Fund | 115 | 0 | 0 | 20 | 0 | 0 | 0 | 16 |
| PIMCO RAE US Fund | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

| | 30. Juni 2018 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Pensionsgeschäfte | | Umgekehrte Pensionsgeschäfte | | Buy-Sellback-Finanzierungsgeschäfte | | Rückkauf-Finanzierungsgeschäfte | |
| Fonds | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) | Renditen (000S) | Kosten (000S) |
| Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund | 4 | $ 0 | 1 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| StocksPLUS™ Fund | 1.921 | 0 | 0 | 44 | 0 | 0 | 0 | 9 |
| Strategic Income Fund | 5 | 0 | 2 | 42 | 0 | 0 | 0 | 26 |
| Total Return Bond Fund | 83 | 0 | 0 | 8.675 | 0 | 0 | 6 | 467 |
| PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund | 193 | 0 | 13 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| UK Corporate Bond Fund | £ 10 | £ 0 | £ 0 | £ 76 | £ 0 | £ 0 | 0 | £ 0 |
| UK Long Term Corporate Bond Fund | 5 | 0 | 0 | 259 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| US High Yield Bond Fund | $ 1.174 | $ 0 | $ 127 | $ 0 | $ 0 | $ 0 | 0 | $ 0 |
| US Investment Grade Corporate Bond Fund | 6 | 0 | 0 | 51 | 0 | 0 | 7 | 109 |
| US Short-Term Fund | 3 | 0 | 1 | 37 | 0 | 0 | 0 | 419 |

Alle Renditen aus SFT-Derivatgeschäften laufen zugunsten des Fonds auf und fallen nicht unter Ertragsteilungsvereinbarungen 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.

## 20. WESENTLICHE EREIGNISSE

Am 14. Februar 2019 wurde der PIMCO Asia High Yield Bond Fund aufgelegt.

Am 26. Februar 2019 genehmigte der Verwaltungsrat die Verschmelzung des PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund mit dem PIMCO RAE Emerging Markets Fund sowie des PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund mit dem PIMCO RAE Global Developed Fund.

Am 29. März 2019 wurde der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund aufgelegt.

Eine Rücknahme in Höhe von USD 12.500.000 im US Short-Term Fund wurde von der Verwaltungsgesellschaft am 17. April 2019 durchgeführt.

Am 4. Juni 2019 wurde der PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund aufgelegt.

Am 5. Juni 2019 wurde der PIMCO RAE PLUS US Fund geschlossen.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren während des Berichtszeitraums keine wesentlichen Ereignisse zu verzeichnen.

## 21. EREIGNISSE NACH ABSCHLUSS DES BERICHTSZEITRAUMS

Am 1. Juli 2019 wurde der Gebührenverzicht für den Euro Credit Fund für alle Klassen bis zum 30. Juni 2020 verlängert und um 0,06 % reduziert, und der Erstzeichnungsbetrag für die Anteilsklasse H Institutional wurde im Verkaufsprospekt von USD 1 Mio. auf USD 125 Mio. aktualisiert.

Am 1. Juli 2019 wurde der Gebührenverzicht für den Low Duration Income Fund auf 0,05 % p.a. verringert und für die Anteilsklassen Class E, Class T und G Retail bis zum 30. Juni 2020 verlängert. Für alle übrigen Anteilsklassen wurde der Gebührenverzicht ohne Veränderung seiner Höhe verlängert.

Am 1. Juli 2019 wurde der Gebührenverzicht für den UK Corporate Bond Fund für alle Klassen bis zum 30. Juni 2020 verlängert, und der Erstzeichnungsbetrag für die Anteilsklasse H Institutional wurde im Verkaufsprospekt von USD 1 Mio. auf USD 125 Mio. aktualisiert.

Die Verschmelzung des PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund mit dem PIMCO RAE Emerging Markets Fund sowie des PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund mit dem PIMCO RAE Global Developed Fund wurde am 26. Juli 2019 durchgeführt.

Am 1. August 2019 wurde der Gebührenverzicht für den PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund für alle Klassen bis zum 31. Juli 2020 verlängert.

Der Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund wurde mit Wirkung zum 2. August 2019 in Emerging Markets Bond ESG Fund umbenannt.

Abgesehen von den oben erwähnten Ereignissen waren nach Abschluss des Berichtszeitraums keine weiteren Ereignisse zu verzeichnen.

## 22. GENEHMIGUNG VON FINANZABSCHLÜSSEN

Dieser Abschluss wurde am 23. August 2019 vom Verwaltungsrat genehmigt.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Asia High Yield Bond Fund



| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | | |
| PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 1.420.209 | $ | 14.218 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Kaisa Group Holdings Ltd. 8,500 % fällig am 30.06.2022 | $ | 3.900 | | 3.548 |
| Mongolia Government International Bond 5,625 % fällig am 01.05.2023 | | 3.500 | | 3.458 |
| Sunac China Holdings Ltd. 8,350 % fällig am 19.04.2023 | | 3.100 | | 3.187 |
| Pakistan Government International Bond 6,875 % fällig am 05.12.2027 | | 3.200 | | 3.166 |
| Sri Lanka Government International Bond 6,125 % fällig am 03.06.2025 | | 3.050 | | 2.939 |
| China Evergrande Group 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 2.800 | | 2.706 |
| Sri Lanka Government International Bond 7,850 % fällig am 14.03.2029 | | 2.650 | | 2.705 |
| Studio City Finance Ltd. 7,250 % fällig am 11.02.2024 | | 2.500 | | 2.573 |
| Easy Tactic Ltd. 8,625 % fällig am 27.02.2024 | | 2.500 | | 2.542 |
| CFLD Cayman Investment Ltd. 8,625 % fällig am 28.02.2021 | | 2.400 | | 2.461 |
| Sri Lanka Government International Bond 6,200 % fällig am 11.05.2027 | | 2.650 | | 2.457 |
| Celestial Miles Ltd. 5,750 % fällig am 31.01.2024 | | 2.200 | | 2.270 |
| Times China Holdings Ltd. 6,250 % fällig am 17.01.2021 | | 2.100 | | 2.103 |
| 21Vianet Group, Inc. 7,875 % fällig am 15.10.2021 | | 2.000 | | 2.038 |
| Vedanta Resources Ltd. 6,125 % fällig am 09.08.2024 | | 2.200 | | 1.963 |
| Proven Honour Capital Ltd. 4,125 % fällig am 06.05.2026 | | 2.000 | | 1.937 |
| China Evergrande Group 4,250 % fällig am 14.02.2023 | HKD | 16.000 | | 1.935 |
| VLL International, Inc. 5,750 % fällig am 28.11.2024 | | 1.925 | | 1.907 |
| Yingde Gases Investment Ltd. 6,250 % fällig am 19.01.2023 | | 1.900 | | 1.902 |
| Zoomlion HK SPV Co. Ltd. 6,125 % fällig am 20.12.2022 | | 1.900 | | 1.883 |
| Sri Lanka Government International Bond 5,750 % fällig am 18.04.2023 | | 1.900 | | 1.856 |
| Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd. 6,750 % fällig am 24.04.2033 | | 1.830 | | 1.814 |
| Royal Capital BV 4,875 % fällig am 05.05.2024 | | 1.800 | | 1.779 |
| Fortune Star BVI Ltd. 5,250 % fällig am 23.03.2022 | | 1.800 | | 1.772 |
| Malaysia Government Bond 4,921 % fällig am 06.07.2048 | MYR | 6.700 | | 1.751 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | | |
| PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 973.855 | $ | 9.750 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Sunac China Holdings Ltd. 8,350 % fällig am 19.04.2023 | $ | 3.100 | | 3.151 |
| Sri Lanka Government International Bond 7,850 % fällig am 14.03.2029 | | 2.650 | | 2.670 |
| Indonesia Government International Bond 1,450 % fällig am 18.09.2026 | € | 1.200 | | 1.398 |
| Medco Platinum Road Pte. Ltd. 6,750 % fällig am 30.01.2025 | $ | 1.300 | | 1.275 |
| Mongolia Government International Bond 5,625 % fällig am 01.05.2023 | | 1.000 | | 1.022 |
| Horse Gallop Finance Ltd. 3,250 % fällig am 30.05.2022 | | 1.000 | | 1.009 |
| Scenery Journey Ltd. 13,750 % fällig am 06.11.2023 | | 800 | | 857 |
| Studio City Finance Ltd. 7,250 % fällig am 11.02.2024 | | 800 | | 827 |
| Baoxin Auto Finance I Ltd. 5,625 % fällig am 30.10.2020 | | 900 | | 824 |
| MGM China Holdings Ltd. 5,875 % fällig am 15.05.2026 | | 700 | | 718 |
| Pakistan Government International Bond 6,875 % fällig am 05.12.2027 | | 700 | | 699 |
| Sunac China Holdings Ltd. 8,375 % fällig am 15.01.2021 | | 650 | | 668 |
| China Evergrande Group 7,500 % fällig am 28.06.2023 | | 700 | | 642 |
| Vigorous Champion International Ltd. 4,250 % fällig am 28.05.2029 | | 600 | | 620 |
| Vigorous Champion International Ltd. 3,625 % fällig am 28.05.2024 | | 600 | | 610 |
| Huaneng Hong Kong Capital Ltd. 3,600 % fällig am 30.10.2022 | | 600 | | 588 |
| Easy Tactic Ltd. 5,750 % fällig am 13.01.2022 | | 600 | | 582 |
| Vedanta Resources Ltd. 6,375 % fällig am 30.07.2022 | | 600 | | 579 |
| Asahi Mutual Life Insurance Co. 6,500 % fällig am 05.09.2023 | | 500 | | 522 |
| IHO Verwaltungs GmbH 3,625 % fällig am 15.05.2025 | € | 400 | | 459 |
| Yanlord Land HK Co. Ltd. 6,750 % fällig am 23.04.2023 | $ | 400 | | 407 |
| Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,950 % fällig am 24.10.2022 | | 400 | | 404 |
| Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022 | | 400 | | 403 |

(a) Der PIMCO Asia High Yield Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Capital Securities Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 5.850.700 | $ 591.361 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % fällig am 29.03.2024 | € | 111.800 | 126.887 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Select Funds plc - US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 11.443.323 | 114.578 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 4,269 % fällig am 22.03.2025 | $ | 86.900 | 88.814 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % fällig am 24.09.2023 | € | 61.600 | 67.944 |
| Barclays PLC 7,125 % fällig am 15.06.2025 | £ | 40.500 | 52.103 |
| Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.06.2024 | $ | 45.600 | 45.600 |
| Societe Generale S.A. 6,750 % fällig am 06.04.2028 | | 47.000 | 43.172 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 3,691 % fällig am 05.06.2028 | | 41.800 | 41.319 |
| Nordea Bank Abp 6,625 % fällig am 26.03.2026 | | 40.400 | 40.667 |
| Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 14.02.2022 | € | 30.000 | 33.994 |
| KBC Group NV 4,750 % fällig am 05.03.2024 | | 29.800 | 33.872 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 4,892 % fällig am 18.05.2029 | $ | 32.326 | 33.720 |
| UniCredit SpA 7,500 % fällig am 03.06.2026 | € | 24.900 | 28.074 |
| Bankinter S.A. 0,875 % fällig am 08.07.2026 | | 23.100 | 26.231 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 21.400 | 24.690 |
| Bankia S.A. 6,375 % fällig am 19.09.2023 | | 20.000 | 21.967 |
| BNP Paribas S.A. 4,705 % fällig am 10.01.2025 | $ | 21.900 | 21.900 |
| Altice Luxembourg S.A. 8,000 % fällig am 15.05.2027 | € | 18.400 | 20.585 |
| ING Groep NV 4,050 % fällig am 09.04.2029 | $ | 20.000 | 20.130 |
| LeasePlan Corp. NV 7,375 % fällig am 29.05.2024 | | 17.900 | 19.958 |
| ASR Nederland NV 4,625 % fällig am 19.10.2027 | | 17.000 | 18.416 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 11.443.323 | $ 114.592 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Lloyds Banking Group PLC 7,625 % fällig am 27.06.2023 | £ | 56.900 | 77.564 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025 | € | 52.100 | 59.388 |
| HSBC Holdings PLC 6,000 % fällig am 29.09.2023 | | 43.200 | 54.289 |
| Barclays PLC 5,875 % fällig am 15.09.2024 | £ | 38.400 | 48.485 |
| Erste Group Bank AG 8,875 % fällig am 15.10.2021 | € | 36.400 | 47.413 |
| Barclays PLC 7,750 % fällig am 15.09.2023 | $ | 40.600 | 41.463 |
| Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 % fällig am 29.12.2049 | € | 31.400 | 41.066 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 2,000 % fällig am 01.11.2028 | | 34.800 | 40.704 |
| Morgan Stanley 2,750 % fällig am 19.05.2022 | $ | 40.000 | 39.840 |
| Bank of Ireland 7,375 % fällig am 18.06.2020 | € | 25.040 | 29.540 |
| Virgin Money Holdings UK PLC 8,750 % fällig am 10.11.2021 | £ | 20.185 | 28.203 |
| Springleaf Finance Corp. 7,125 % fällig am 15.03.2026 | $ | 26.000 | 26.436 |
| Wells Fargo & Co. 3,069 % fällig am 24.01.2023 | | 25.000 | 25.067 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % fällig am 26.04.2022 | | 25.000 | 24.994 |
| American International Group, Inc. 5,750 % fällig am 01.04.2048 | | 25.800 | 24.889 |
| Standard Chartered PLC 7,750 % fällig am 02.04.2023 | | 21.500 | 22.480 |
| Bank of America Corp. 2,881 % fällig am 24.04.2023 | | 21.600 | 21.523 |
| Nykredit Realkredit A/S 6,250 % fällig am 26.10.2020 | € | 16.015 | 19.242 |
| Deutsche Bank AG 4,250 % fällig am 14.10.2021 | $ | 19.200 | 19.223 |
| CNP Assurances 4,750 % fällig am 27.06.2028 | € | 16.700 | 18.962 |
| Cooperatieve Rabobank UA 6,910 % fällig am 10.06.2038 | £ | 10.000 | 18.277 |
| AIB Group PLC 2,250 % fällig am 03.07.2025 | € | 15.600 | 18.102 |
| Lloyds Banking Group PLC 7,500 % fällig am 27.09.2025 | $ | 16.900 | 16.966 |
| Deutsche Bank AG 2,625 % fällig am 12.02.2026 | € | 13.200 | 15.160 |
| Barclays PLC 4,375 % fällig am 12.01.2026 | $ | 15.000 | 14.958 |
| Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,750 % fällig am 18.02.2020 | € | 12.000 | 14.032 |
| CYBG PLC 4,000 % fällig am 25.09.2026 | £ | 10.000 | 13.181 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 1,750 % fällig am 02.03.2026 | € | 11.200 | 12.977 |
| Dresdner Funding Trust 8,151 % fällig am 30.06.2031 | $ | 10.000 | 12.646 |
| NN Group NV 4,500 % fällig am 15.01.2026 | € | 10.000 | 11.904 |
| Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama 3,375 % fällig am 24.09.2028 | | 10.700 | 11.863 |

(a) Der PIMCO Capital Securities Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Commodity Real Return Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2021 (a) | $ | 30.344 | $ 29.941 |
| **France Government International Bond** 2,250 % fällig am 25.07.2020 | € | 16.338 | 19.543 |
| **United Kingdom Gilt Inflation Linked** 0,125 % fällig am 22.03.2026 (a) | £ | 10.026 | 15.383 |
| **France Government International Bond** 2,100 % fällig am 25.07.2023 | € | 11.445 | 14.809 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,875 % fällig am 15.01.2029 (a) | $ | 12.838 | 13.106 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 2,600 % fällig am 15.09.2023 | € | 10.105 | 12.251 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.07.2027 (a) | $ | 11.750 | 11.574 |
| **France Government International Bond** 1,100 % fällig am 25.07.2022 | € | 8.792 | 10.824 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.01.2027 (a) | $ | 8.386 | 8.272 |
| **United Kingdom Gilt** 1,250 % fällig am 22.11.2027 | £ | 4.464 | 7.728 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2020 (a) | $ | 6.976 | 6.891 |
| **Spain Government International Bond** 0,650 % fällig am 30.11.2027 | € | 5.457 | 6.652 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 1,125 % fällig am 15.01.2021 (a) | $ | 6.327 | 6.368 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 41.700 | 6.293 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 2,000 % fällig am 01.04.2020 | | 39.300 | 6.136 |
| **United Kingdom Gilt** 0,125 % fällig am 10.08.2028 | £ | 3.426 | 5.539 |
| **Jyske Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 35.600 | 5.379 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 1,250 % fällig am 15.07.2020 (a) | $ | 5.318 | 5.332 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 10.03.2028 | ¥ | 529.362 | 5.007 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2019 (a) | $ | 4.929 | 4.918 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2026 (a) | | 4.874 | 4.728 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,750 % fällig am 15.07.2028 (a) | | 4.548 | 4.583 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** 2,000 % fällig am 01.04.2020 | DKK | 22.100 | 3.436 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 2.400 | 3.173 |
| **Fannie Mae** 2,804 % fällig am 25.03.2049 | $ | 3.000 | 2.991 |
| **Ginnie Mae** 2,783 % fällig am 20.02.2049 | | 2.900 | 2.891 |
| **Saxon Asset Securities Trust** 2,694 % fällig am 25.09.2036 | | 3.000 | 2.783 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2019 (a) | $ | 52.981 | $ 52.830 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2020 (a) | | 37.694 | 37.342 |
| **France Government International Bond** 0,100 % fällig am 01.03.2021 | € | 19.552 | 22.821 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 1,250 % fällig am 15.07.2020 (a) | $ | 20.264 | 20.371 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2024 (a) | | 19.060 | 18.746 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** 0,100 % fällig am 15.05.2022 | € | 15.301 | 17.052 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2022 (a) | $ | 8.304 | 8.246 |
| **France Government International Bond** 1,850 % fällig am 25.07.2027 | € | 5.067 | 7.124 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,875 % fällig am 15.01.2029 (a) | $ | 5.671 | 5.864 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 1,000 % fällig am 15.02.2048 (a) | | 5.651 | 5.624 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,625 % fällig am 15.07.2021 (a) | | 4.127 | 4.153 |
| **United Kingdom Gilt** 0,125 % fällig am 10.08.2048 | £ | 1.387 | 3.062 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,875 % fällig am 15.02.2047 (a) | $ | 2.138 | 2.079 |
| **United Kingdom Gilt** 1,750 % fällig am 07.09.2037 | £ | 930 | 1.227 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 2,500 % fällig am 15.01.2029 (a) | $ | 1.020 | 1.181 |
| **France Government International Bond** 0,250 % fällig am 25.07.2024 | € | 954 | 1.150 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,625 % fällig am 15.04.2023 (a) | $ | 1.117 | 1.102 |
| **Argentina Government International Bond** 6,875 % fällig am 26.01.2027 | | 1.200 | 918 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.07.2025 (a) | | 808 | 817 |
| **Easy Tactic Ltd.** 9,125 % fällig am 28.07.2022 | | 700 | 733 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2029 | $ | 8.692 | $ 8.847 |
| U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.05.2024 | | 6.830 | 6.839 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 29.02.2024 | | 2.600 | 2.594 |
| U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 31.01.2024 | | 2.500 | 2.503 |
| MGM China Holdings Ltd. 5,375 % fällig am 15.05.2024 | | 2.200 | 2.215 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 154.924 | 1.551 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Virgin Media Receivables Financing Notes DAC 5,500 % fällig am 15.09.2024 | £ | 1.000 | 1.304 |
| Netflix, Inc. 3,875 % fällig am 15.11.2029 | € | 1.000 | 1.146 |
| Bombardier, Inc. 7,500 % fällig am 01.12.2024 | $ | 1.100 | 1.116 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 1.100 | 1.101 |
| Novatek OAO via Novatek Finance DAC 4,422 % fällig am 13.12.2022 | | 1.100 | 1.098 |
| Beacon Roofing Supply, Inc. 4,875 % fällig am 01.11.2025 | | 1.100 | 1.030 |
| Ancestry.com Operations, Inc. 5,660 % fällig am 19.10.2023 | | 1.000 | 988 |
| iStar, Inc. 5,250 % fällig am 15.09.2022 | | 1.000 | 966 |
| Banco Santander S.A. 6,250 % fällig am 11.09.2021 | € | 800 | 906 |
| Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,750 % fällig am 23.01.2029 | $ | 800 | 856 |
| Frontera Energy Corp. 9,700 % fällig am 25.06.2023 | | 800 | 851 |
| China Evergrande Group 6,250 % fällig am 28.06.2021 | | 900 | 843 |
| MGM Resorts International 5,500 % fällig am 15.04.2027 | | 800 | 800 |
| Studio City Finance Ltd. 7,250 % fällig am 11.02.2024 | | 800 | 800 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 2,800 % fällig am 21.07.2023 | | 900 | 798 |
| Transocean Sentry Ltd. 5,375 % fällig am 15.05.2023 | | 800 | 796 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 800 | 795 |
| LeasePlan Corp. NV 7,375 % fällig am 29.05.2024 | € | 700 | 780 |
| Quicken Loans, Inc. 5,250 % fällig am 15.01.2028 | $ | 800 | 753 |
| Par Pharmaceutical, Inc. 7,500 % fällig am 01.04.2027 | | 700 | 725 |
| CSN Resources S.A. 7,625 % fällig am 13.02.2023 | | 700 | 709 |
| Tenet Healthcare Corp. 6,250 % fällig am 01.02.2027 | | 700 | 700 |
| Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 600 | 699 |
| Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 4,071 % fällig am 25.05.2023 | $ | 700 | 684 |
| TopBuild Corp. 5,625 % fällig am 01.05.2026 | | 700 | 684 |
| CPI Property Group S.A. 4,750 % fällig am 08.03.2023 | | 600 | 608 |
| CSN Resources S.A. 7,625 % fällig am 13.02.2023 | | 600 | 605 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| Virgin Media Receivables Financing Notes DAC 5,500 % fällig am 15.09.2024 | £ | 1.400 | $ 1.870 |
| Antero Midstream Partners LP 5,375 % fällig am 15.09.2024 | $ | 1.700 | 1.737 |
| Masonite International Corp. 5,750 % fällig am 15.09.2026 | | 1.500 | 1.532 |
| TopBuild Corp. 5,625 % fällig am 01.05.2026 | | 1.500 | 1.510 |
| Alpha Star Holding Ltd. 4,970 % fällig am 09.04.2019 | | 1.425 | 1.421 |
| Kennedy-Wilson, Inc. 5,875 % fällig am 01.04.2024 | | 1.400 | 1.414 |
| Ambac LSNI LLC 7,803 % fällig am 12.02.2023 | | 1.261 | 1.271 |
| Hilton Domestic Operating Co., Inc. 5,125 % fällig am 01.05.2026 | | 1.200 | 1.206 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 119.868 | 1.200 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Jeld-Wen, Inc. 4,625 % fällig am 15.12.2025 | $ | 1.200 | 1.149 |
| Targa Resources Partners LP 5,000 % fällig am 15.01.2028 | | 1.100 | 1.082 |
| iStar, Inc. 5,250 % fällig am 15.09.2022 | | 1.000 | 1.003 |
| Ancestry.com Operations, Inc. 5,660 % fällig am 19.10.2023 | | 1.000 | 983 |
| Tallgrass Energy Partners LP 4,750 % fällig am 01.10.2023 | | 900 | 901 |
| Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 2.800 | 872 |
| Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,750 % fällig am 23.01.2029 | $ | 800 | 855 |
| Jeld-Wen, Inc. 4,875 % fällig am 15.12.2027 | | 900 | 849 |
| China Evergrande Group 6,250 % fällig am 28.06.2021 | | 900 | 844 |
| Studio City Finance Ltd. 7,250 % fällig am 11.02.2024 | | 800 | 826 |
| Yanlord Land HK Co. Ltd. 6,750 % fällig am 23.04.2023 | | 800 | 814 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 800 | 809 |
| MGM Resorts International 5,500 % fällig am 15.04.2027 | | 800 | 807 |
| Equinix, Inc. 2,875 % fällig am 15.03.2024 | € | 700 | 807 |
| MGM Resorts International 5,750 % fällig am 15.06.2025 | $ | 700 | 738 |
| CSN Resources S.A. 7,625 % fällig am 13.02.2023 | | 700 | 734 |
| Tenet Healthcare Corp. 6,000 % fällig am 01.10.2020 | | 700 | 724 |
| Tenet Healthcare Corp. 6,250 % fällig am 01.02.2027 | | 700 | 701 |
| Crown Americas LLC 4,750 % fällig am 01.02.2026 | | 700 | 698 |
| Par Pharmaceutical, Inc. 7,500 % fällig am 01.04.2027 | | 700 | 694 |
| Melco Resorts Finance Ltd. 4,875 % fällig am 06.06.2025 | | 700 | 687 |
| Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 700 | 677 |
| MGM Resorts International 4,625 % fällig am 01.09.2026 | | 700 | 666 |
| Howard Hughes Corp. 5,375 % fällig am 15.03.2025 | | 650 | 642 |
| CSN Resources S.A. 7,625 % fällig am 13.02.2023 | | 600 | 620 |
| | | **AKTIEN** | |
| Caesars Entertainment Corp. | | 69.175 | 618 |
| | | **PARI (000S)** | |
| HSBC Holdings PLC 5,250 % fällig am 16.09.2022 | € | 500 | 587 |
| DAE Funding LLC 5,250 % fällig am 15.11.2021 | $ | 575 | 584 |

(a) Der PIMCO Credit Opportunities 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income Fund



| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 14.655.529 | $ 146.756 |
| | | **PARI (000S)** | |
| BNP Paribas S.A. 4,705 % fällig am 10.01.2025 | $ | 48.300 | 48.300 |
| South Africa Government International Bond 5,875 % fällig am 16.09.2025 | | 40.100 | 42.875 |
| Russia Government International Bond 2,875 % fällig am 04.12.2025 | € | 30.700 | 35.935 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 25.200 | 33.314 |
| Greece Treasury Bills 0,000 % fällig am 30.08.2019 | € | 26.970 | 30.442 |
| Netflix, Inc. 3,875 % fällig am 15.11.2029 | | 26.500 | 30.065 |
| Sunac China Holdings Ltd. 7,950 % fällig am 11.10.2023 | $ | 28.900 | 28.579 |
| Deutsche Bank AG 3,875 % fällig am 12.02.2024 | £ | 18.800 | 24.174 |
| Sunac China Holdings Ltd. 7,250 % fällig am 14.06.2022 | $ | 22.200 | 22.093 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a) | | 2.136.098 | 22.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024 | € | 19.100 | 21.491 |
| INEOS Finance PLC 2,875 % fällig am 01.05.2026 | | 18.300 | 20.609 |
| China Evergrande Group 9,500 % fällig am 11.04.2022 | $ | 20.100 | 20.100 |
| Volkswagen Leasing GmbH 2,625 % fällig am 15.01.2024 | € | 15.900 | 18.951 |
| Charter Communications Operating LLC 5,125 % fällig am 01.07.2049 | $ | 16.600 | 16.580 |
| Dell International LLC 5,300 % fällig am 01.10.2029 | | 16.400 | 16.287 |
| Turkey Government International Bond 4,625 % fällig am 31.03.2025 | € | 13.700 | 15.455 |
| Egypt Government International Bond 4,750 % fällig am 11.04.2025 | | 13.700 | 15.403 |
| CPI Property Group S.A. 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 14.600 | 14.567 |
| Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 14.100 | 13.989 |
| Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3,000 % fällig am 29.03.2025 | € | 11.739 | 13.395 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| Sunac China Holdings Ltd. 7,950 % fällig am 11.10.2023 | $ | 22.200 | $ 22.201 |
| Tesco Property Finance PLC 6,052 % fällig am 13.10.2039 | £ | 13.648 | 21.615 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 1.767.770 | 17.700 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Equinix, Inc. 2,875 % fällig am 01.02.2026 | € | 14.500 | 16.874 |
| Wynn Las Vegas LLC 5,500 % fällig am 01.03.2025 | $ | 16.300 | 15.943 |
| Co-operative Group Holdings Ltd. 7,500 % fällig am 08.07.2026 | £ | 10.520 | 15.469 |
| Crown European Holdings S.A. 3,375 % fällig am 15.05.2025 | € | 11.000 | 13.331 |
| SoftBank Group Corp. 4,000 % fällig am 20.04.2023 | | 10.200 | 12.131 |
| Wynn Las Vegas LLC 5,250 % fällig am 15.05.2027 | $ | 13.400 | 12.127 |
| UPCB Finance Ltd. 3,625 % fällig am 15.06.2029 | € | 10.000 | 11.780 |
| FirstEnergy Corp. 7,375 % fällig am 15.11.2031 | $ | 8.400 | 11.042 |
| TDC A/S 5,625 % fällig am 23.02.2023 | £ | 7.100 | 10.442 |
| Calpine Corp. 5,250 % fällig am 01.06.2026 | $ | 8.730 | 8.724 |
| Navient Corp. 6,500 % fällig am 15.06.2022 | | 8.200 | 8.628 |
| Volkswagen Financial Services AG 0,875 % fällig am 12.04.2023 | € | 7.600 | 8.595 |
| thyssenkrupp AG 2,875 % fällig am 22.02.2024 | | 7.400 | 8.378 |
| Natwest Markets PLC 0,625 % fällig am 02.03.2022 | | 6.900 | 7.831 |
| Casino Guichard Perrachon S.A. 5,244 % fällig am 09.03.2020 | | 6.000 | 7.124 |
| Dometic Group AB 3,000 % fällig am 08.05.2026 | | 6.500 | 7.044 |
| Barclays PLC 5,088 % fällig am 20.06.2030 | $ | 6.900 | 6.914 |
| Staples, Inc. 7,500 % fällig am 15.04.2026 | | 6.800 | 6.675 |
| SoftBank Group Corp. 5,000 % fällig am 15.04.2028 | € | 5.900 | 6.649 |
| Ziggo Secured Finance BV 3,000 % fällig am 15.04.2025 | | 5.500 | 6.201 |
| HSBC Holdings PLC 4,750 % fällig am 04.07.2029 | | 5.700 | 6.173 |
| Wind Tre SpA 3,125 % fällig am 20.01.2025 | | 5.400 | 6.052 |
| Volkswagen International Finance NV 4,125 % fällig am 16.11.2038 | | 4.100 | 5.675 |
| Lloyds Bank PLC 7,625 % fällig am 22.04.2025 | £ | 3.000 | 4.857 |
| United Group BV 4,875 % fällig am 01.07.2024 | € | 4.100 | 4.829 |
| Altice Luxembourg S.A. 10,500 % fällig am 15.05.2027 | $ | 4.600 | 4.633 |
| Greif Nevada Holdings, Inc. SCS 7,375 % fällig am 15.07.2021 | € | 3.650 | 4.628 |
| Altice Financing S.A. 6,625 % fällig am 15.02.2023 | $ | 4.500 | 4.586 |
| Drax Finco PLC 6,625 % fällig am 01.11.2025 | | 4.500 | 4.568 |

(a) Der Diversified Income Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Diversified Income Duration Hedged Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| **BNP Paribas S.A.** | | | |
| 4,705 % fällig am 10.01.2025 | $ | 8.900 | $ 8.900 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 788.681 | 7.897 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **South Africa Government International Bond** | | | |
| 5,875 % fällig am 16.09.2025 | $ | 6.500 | 6.938 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 4.700 | 6.213 |
| **Russia Government International Bond** | | | |
| 2,875 % fällig am 04.12.2025 | € | 4.800 | 5.618 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | |
| 7,950 % fällig am 11.10.2023 | $ | 5.400 | 5.340 |
| **Netflix, Inc.** | | | |
| 3,875 % fällig am 15.11.2029 | € | 4.700 | 5.331 |
| **Deutsche Bank AG** | | | |
| 3,875 % fällig am 12.02.2024 | £ | 3.700 | 4.757 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a)** | | 385.171 | 4.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **China Evergrande Group** | | | |
| 9,500 % fällig am 11.04.2022 | $ | 3.700 | 3.700 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 | | 3.600 | 3.581 |
| **INEOS Finance PLC** | | | |
| 2,875 % fällig am 01.05.2026 | € | 3.000 | 3.378 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 5,300 % fällig am 01.10.2029 | $ | 3.300 | 3.277 |
| **Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.** | | | |
| 6,000 % fällig am 29.03.2024 | € | 2.800 | 3.189 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** | | | |
| 2,625 % fällig am 15.01.2024 | | 2.600 | 3.098 |
| **Ziggo Secured Finance Partnership** | | | |
| 4,894 % fällig am 15.04.2025 | $ | 3.100 | 3.002 |
| **Deutsche Bank AG** | | | |
| 3,375 % fällig am 12.05.2021 | | 2.800 | 2.731 |
| **Egypt Government International Bond** | | | |
| 4,750 % fällig am 11.04.2025 | € | 2.400 | 2.698 |
| **CPI Property Group S.A.** | | | |
| 4,750 % fällig am 08.03.2023 | $ | 2.700 | 2.695 |
| **Aroundtown S.A.** | | | |
| 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 2.700 | 2.679 |
| **Deutsche Bank AG** | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 2.000 | 2.281 |
| **Altice Financing S.A.** | | | |
| 7,500 % fällig am 15.05.2026 | $ | 2.360 | 2.277 |
| **Royal Bank of Scotland Group PLC** | | | |
| 2,000 % fällig am 08.03.2023 | € | 1.900 | 2.213 |
| **IHO Verwaltungs GmbH** | | | |
| 2,750 % fällig am 15.09.2021 | | 1.900 | 2.162 |
| **Globalworth Real Estate Investments Ltd.** | | | |
| 3,000 % fällig am 29.03.2025 | | 1.900 | 2.158 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 599.341 | $ 6.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | |
| 7,950 % fällig am 11.10.2023 | $ | 3.600 | 3.599 |
| **Tesco Property Finance PLC** | | | |
| 6,052 % fällig am 13.10.2039 | £ | 2.225 | 3.524 |
| **Ziggo Secured Finance BV** | | | |
| 3,000 % fällig am 15.04.2025 | € | 3.100 | 3.495 |
| **Co-operative Group Holdings Ltd.** | | | |
| 7,500 % fällig am 08.07.2026 | £ | 2.200 | 3.235 |
| **Equinix, Inc.** | | | |
| 2,875 % fällig am 01.02.2026 | € | 2.500 | 2.909 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.06.2022 | $ | 2.600 | 2.736 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | |
| 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 2.700 | 2.660 |
| **Wynn Las Vegas LLC** | | | |
| 5,250 % fällig am 15.05.2027 | | 2.500 | 2.263 |
| **FirstEnergy Corp.** | | | |
| 7,375 % fällig am 15.11.2031 | | 1.400 | 1.840 |
| **Casino Guichard Perrachon S.A.** | | | |
| 5,244 % fällig am 09.03.2020 | € | 1.500 | 1.782 |
| **Crown European Holdings S.A.** | | | |
| 3,375 % fällig am 15.05.2025 | | 1.400 | 1.696 |
| **TDC A/S** | | | |
| 5,625 % fällig am 23.02.2023 | £ | 1.100 | 1.618 |
| **thyssenkrupp AG** | | | |
| 2,875 % fällig am 22.04.2024 | € | 1.300 | 1.472 |
| **Altice Luxembourg S.A.** | | | |
| 10,500 % fällig am 15.05.2027 | $ | 1.400 | 1.410 |
| **Calpine Corp.** | | | |
| 5,250 % fällig am 01.06.2026 | | 1.340 | 1.339 |
| **Casino Guichard Perrachon S.A.** | | | |
| 5,976 % fällig am 26.05.2021 | € | 1.100 | 1.331 |
| **Dometic Group AB** | | | |
| 3,000 % fällig am 08.05.2026 | | 1.200 | 1.302 |
| **UPCB Finance Ltd.** | | | |
| 3,625 % fällig am 15.06.2029 | | 1.100 | 1.294 |
| **Altice Financing S.A.** | | | |
| 6,625 % fällig am 15.02.2023 | $ | 1.260 | 1.284 |
| **Staples, Inc** | | | |
| 7,500 % fällig am 15.04.2026 | | 1.300 | 1.277 |
| **Natwest Markets PLC** | | | |
| 0,625 % fällig am 02.03.2022 | € | 1.100 | 1.248 |
| **Barclays PLC** | | | |
| 5,088 % fällig am 20.06.2030 | $ | 1.100 | 1.102 |
| **Volkswagen Group of America Finance LLC** | | | |
| 3,875 % fällig am 13.11.2020 | | 1.000 | 1.013 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 944 | 979 |
| **Volkswagen International Finance NV** | | | |
| 4,125 % fällig am 16.11.2038 | € | 700 | 969 |
| **Intesa Sanpaolo SpA** | | | |
| 7,750 % fällig am 11.01.2027 | | 800 | 968 |
| **Country Garden Holdings Co. Ltd.** | | | |
| 6,500 % fällig am 08.04.2024 | $ | 900 | 909 |
| **Greif Nevada Holdings, Inc. SCS** | | | |
| 7,375 % fällig am 15.07.2021 | € | 700 | 888 |
| **HSBC Holdings PLC** | | | |
| 4,750 % fällig am 04.07.2029 | | 800 | 866 |

(a) Der Diversified Income Duration Hedged Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Dynamic Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 30.124.592 | $ 301.621 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Fannie Mae UMBS** 3,500 % fällig am 01.05.2049 | $ | 234.478 | 237.070 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,250 % fällig am 30.04.2024 | | 85.200 | 85.468 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 68.412 | 71.128 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,000 % fällig am 31.05.2024 | | 47.800 | 48.073 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,250 % fällig am 30.04.2021 | | 47.400 | 47.441 |
| **Fannie Mae UMBS** 3,500 % fällig am 01.11.2048 | | 38.359 | 38.755 |
| **Fannie Mae UMBS** 4,000 % fällig am 01.04.2048 | | 34.323 | 35.263 |
| **Fannie Mae UMBS** 3,500 % fällig am 01.07.2048 | | 24.208 | 24.663 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 13.600 | 17.979 |
| **Ginnie Mae** 3,500 % fällig am 15.07.2045 | $ | 16.592 | 17.071 |
| **Peru Government International Bond** 6,350 % fällig am 12.08.2028 | PEN | 41.300 | 13.285 |
| **Aroundtown S.A.** 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 13.200 | 13.096 |
| **Tikehau CLO BV** 0,880 % fällig am 07.12.2029 | € | 11.000 | 12.446 |
| **Synchrony Financial** 5,150 % fällig am 19.03.2029 | $ | 11.500 | 12.012 |
| **Peru Government International Bond** 6,150 % fällig am 12.08.2032 | PEN | 37.500 | 11.855 |
| **Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates** 2,874 % fällig am 25.11.2035 | $ | 10.400 | 10.251 |
| **Fiserv, Inc.** 2,750 % fällig am 01.07.2024 | | 9.800 | 9.784 |
| **JPMorgan Chase & Co.** 4,005 % fällig am 23.04.2029 | | 9.000 | 9.608 |
| **CPI Property Group S.A.** 4,750 % fällig am 08.03.2023 | | 9.300 | 9.247 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2021 (b) | $ | 327.818 | $ 320.914 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 19.806.819 | 198.306 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **ING Groep NV** 3,797 % fällig am 02.10.2023 | $ | 8.700 | 8.675 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 5.800 | 5.824 |
| **Cardinal Health, Inc.** 2,616 % fällig am 15.06.2022 | | 5.300 | 5.216 |
| **Structured Asset Securities Corp. Trust** 2,864 % fällig am 25.09.2035 | | 4.200 | 4.035 |
| **CVS Health Corp.** 4,100 % fällig am 25.03.2025 | | 3.500 | 3.567 |
| **Bank of America Corp.** 4,667 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 47.000 | 3.189 |
| **Virgin Media Bristol LLC** 4,955 % fällig am 15.01.2026 | $ | 3.200 | 3.156 |
| **Daimler Finance North America LLC** 3,403 % fällig am 22.02.2022 | | 3.000 | 3.019 |
| **Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.** 4,150 % fällig am 23.01.2025 | | 2.800 | 2.929 |
| **Daimler International Finance BV** 0,625 % fällig am 27.02.2023 | € | 2.400 | 2.732 |
| **UniCredit SpA** 7,500 % fällig am 19.03.2019 | | 2.000 | 2.315 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** 3,550 % fällig am 08.07.2022 | $ | 2.300 | 2.306 |
| **Barclays PLC** 7,750 % fällig am 15.09.2023 | | 2.300 | 2.285 |
| **Station Casinos LLC** 5,03 % fällig am 08.06.2023 | | 1.995 | 1.982 |
| **Sirius XM Radio, Inc.** 3,875 % fällig am 01.08.2022 | | 1.900 | 1.857 |
| **HSBC Holdings PLC** 4,583 % fällig am 19.06.2029 | | 1.700 | 1.809 |
| **Countrywide Asset-Backed Certificates** 3,454 % fällig am 25.08.2035 | | 1.737 | 1.739 |
| **Keurig Dr Pepper, Inc.** 3,551 % fällig am 25.05.2021 | | 1.600 | 1.616 |

(a) Der Dynamic Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Dynamic Multi-Asset Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 856.300 | $ 85.726 |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index Source UCITS ETF (a) | | 2.751.500 | 27.110 |
| QUALCOMM, Inc. | | 451.500 | 21.192 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Income Fund (a) | | 1.508.911 | 19.878 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Carrington Mortgage Loan Trust 2,804 % fällig am 25.01.2036 | $ | 18.000 | 14.666 |
| | | **AKTIEN** | |
| Micron Technology, Inc. | | 365.500 | 13.704 |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Capital Securities Fund (a) | | 1.111.442 | 11.133 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Imperial Brands Finance PLC 2,250 % fällig am 26.02.2021 | € | 10.200 | 10.545 |
| Barclays PLC 1,875 % fällig am 23.03.2021 | | 10.100 | 10.417 |
| British Telecommunications PLC 0,625 % fällig am 10.03.2021 | | 9.900 | 10.003 |
| | | **AKTIEN** | |
| Twitter, Inc. | | 277.600 | 9.666 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 2,000 % fällig am 01.04.2020 | DKK | 70.000 | 9.651 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates 2,544 % fällig am 25.08.2037 | $ | 10.179 | 8.787 |
| LeasePlan Corp. NV 1,000 % fällig am 24.05.2021 | € | 8.600 | 8.741 |
| | | **AKTIEN** | |
| Humana, Inc. | | 36.500 | 8.701 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Qatar National Bank 0,000 % fällig am 11.10.2019 | € | 8.000 | 8.005 |
| | | **AKTIEN** | |
| Xilinx, Inc. | | 69.900 | 7.934 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Stockholms Lans Landsting 0,750 % fällig am 26.02.2025 | € | 7.000 | 7.185 |
| | | **AKTIEN** | |
| NVIDIA Corp. | | 48.900 | 6.714 |
| Bristol-Myers Squibb Co. | | 144.700 | 6.402 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Saxon Asset Securities Trust 2,694 % fällig am 25.09.2036 | $ | 7.500 | 6.113 |
| | | **AKTIEN** | |
| Tencent Holdings Ltd. | | 151.400 | 6.049 |
| Electronic Arts | | 70.600 | 5.947 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Bear Stearns ALT-A Trust 4,018 % fällig am 25.09.2047 | $ | 8.392 | 5.943 |
| Commerzbank AG 0,125 % fällig am 09.01.2024 | € | 5.500 | 5.478 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Mortgage Opportunities Fund (a) | | 6.904.677 | $ 69.275 |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 543.900 | 54.473 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 23.396 | 23.559 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 22.104 | 18.667 |
| | | **AKTIEN** | |
| Oracle Corp. | | 320.780 | 14.780 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 18.03.2019 | € | 13.300 | 13.328 |
| | | **AKTIEN** | |
| QUALCOMM, Inc. | | 200.000 | 11.022 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,500 % fällig am 22.01.2020 | € | 10.000 | 10.179 |
| Autobahnen- und Schnellstrassen-Finanzierungs AG 4,375 % fällig am 08.07.2019 | | 10.000 | 10.167 |
| Province of Quebec 5 % fällig am 29.04.2019 | | 9.960 | 10.040 |
| | | **AKTIEN** | |
| HP, Inc. | | 539.610 | 9.244 |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 900.000 | 8.829 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Caisse Centrale du Credit Immobilier de France S.A. 0,000 % fällig am 22.04.2019 | € | 8.500 | 8.517 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | $ | 8.882 | 7.470 |
| Dexia Credit Local S.A. 1,375 % fällig am 18.09.2019 | € | 6.950 | 7.014 |
| BNG Bank NV 3,875 % fällig am 04.11.2019 | | 6.000 | 6.184 |
| | | **AKTIEN** | |
| Applied Materials, Inc. | | 158.890 | 5.757 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,000 % fällig am 29.03.2021 | € | 5.700 | 5.743 |
| Country Garden Holdings Co. Ltd. 7,125 % fällig am 27.01.2022 | $ | 5.600 | 5.131 |
| Landwirtschaftliche Rentenbank 1,625 % fällig am 01.10.2019 | € | 5.000 | 5.065 |
| FMS Wertmanagement 0,000 % fällig am 18.09.2020 | | 5.000 | 5.032 |
| FMS Wertmanagement 0,000 % fällig am 15.04.2019 | | 5.000 | 5.005 |
| Country Garden Holdings Co. Ltd. 6,500 % fällig am 08.04.2024 | $ | 5.000 | 4.573 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,375 % fällig am 22.07.2019 | € | 4.390 | 4.409 |
| | | **AKTIEN** | |
| Vertex Pharmaceuticals, Inc. | | 26.090 | 4.313 |
| Biogen, Inc. | | 14.490 | 4.168 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Ziggo Bond Co. BV 7,125 % fällig am 15.05.2024 | € | 4.000 | 4.163 |

(a) Der Dynamic Multi-Asset 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Asia Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 539.764 | $ 5.404 |
| Sunac China Holdings Ltd. 7,875 % fällig am 15.02.2022 | $ | 500 | 500 |
| Malaysia Government International Bond 4,921 % fällig am 06.07.2048 | MYR | 1.700 | 444 |
| CNOOC Finance USA LLC 4,375 % fällig am 02.05.2028 | $ | 400 | 436 |
| Easy Tactic Ltd. 8,625 % fällig am 27.02.2024 | | 400 | 412 |
| Export-Import Bank of India 3,875 % fällig am 12.03.2024 | | 400 | 408 |
| State Bank of India 4,500 % fällig am 28.09.2023 | | 400 | 406 |
| Vedanta Resources Finance PLC 8,000 % fällig am 23.04.2023 | | 400 | 400 |
| Champion Sincerity Holdings Ltd. 8,125 % fällig am 08.02.2022 | | 400 | 400 |
| China Aoyuan Group Ltd. 8,500 % fällig am 23.01.2022 | | 400 | 400 |
| ReNew Power Synthetic 6,670 % fällig am 12.03.2024 | | 400 | 400 |
| RKPF Overseas 2019 B Ltd. 7,750 % fällig am 18.04.2021 | | 400 | 400 |
| Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,700 % fällig am 27.02.2022 | | 400 | 400 |
| CFLD Cayman Investment Ltd. 8,625 % fällig am 28.02.2021 | | 400 | 400 |
| GLP China Holdings Ltd. 4,974 % fällig am 26.02.2024 | | 400 | 400 |
| LLPL Capital 6,875 % fällig am 04.02.2039 | | 400 | 400 |
| Delhi International Airport Ltd. 6,450 % fällig am 04.06.2029 | | 400 | 400 |
| Sri Lanka Government International Bond 7,850 % fällig am 14.03.2029 | | 400 | 400 |
| CK Hutchison International Ltd. 3,250 % fällig am 11.04.2024 | | 400 | 400 |
| NTPC Ltd. 3,750 % fällig am 03.04.2024 | | 400 | 400 |
| Horse Gallop Finance Ltd. 3,250 % fällig am 30.05.2022 | | 400 | 399 |
| 21Vianet Group, Inc. 7,875 % fällig am 15.10.2021 | | 400 | 399 |
| Celestial Dynasty Ltd. 4,250 % fällig am 27.06.2029 | | 400 | 399 |
| Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT 3,950 % fällig am 28.03.2024 | | 400 | 399 |
| Alam Synergy 11,500 % fällig am 22.04.2021 | | 400 | 399 |
| Johnson Electric Holdings Ltd. 4,125 % fällig am 30.07.2024 | | 400 | 398 |
| Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 400 | 397 |
| Oil India Ltd. 5,125 % fällig am 04.02.2029 | | 400 | 397 |
| China Resources Land Ltd. 4,125 % fällig am 26.02.2029 | | 400 | 396 |
| Bank Mandiri Persero Tbk PT 3,750 % fällig am 11.04.2024 | | 400 | 396 |
| Shinhan Bank Co. Ltd. 4,000 % fällig am 23.04.2029 | | 400 | 396 |
| Kookmin Bank 4,500 % fällig am 01.02.2029 | | 400 | 396 |
| Tencent Holdings Ltd. 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 400 | 392 |
| Zoomlion HK SPV Co. Ltd. 6,125 % fällig am 20.12.2022 | | 400 | 386 |
| Sri Lanka Government International Bond 6,125 % fällig am 03.06.2025 | | 400 | 381 |
| China Evergrande Group 8,250 % fällig am 23.03.2022 | | 400 | 378 |
| Far East Horizon Ltd. 4,350 % fällig am 14.06.2022 | | 400 | 358 |
| Indonesia Government International Bond 1,450 % fällig am 18.09.2026 | € | 300 | 339 |
| Bright Food Singapore Holdings 1,375 % fällig am 19.06.2024 | | 300 | 338 |
| Optus Finance Pty. Ltd. 1,000 % fällig am 20.06.2029 | | 300 | 336 |
| Perusahaan Listrik Negara PT 5,375 % fällig am 25.01.2029 | $ | 300 | 313 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 532.415 | $ 5.330 |
| State Grid Overseas Investment Ltd. 3,500 % fällig am 04.05.2027 | $ | 700 | 500 |
| Sunac China Holdings Ltd. 8,625 % fällig am 27.07.2020 | | 500 | 444 |
| Oil India Ltd. 5,125 % fällig am 04.02.2029 | | 400 | 436 |
| Alam Synergy 11,500 % fällig am 22.04.2021 | | 400 | 412 |
| Champion Sincerity Holdings Ltd. 8,125 % fällig am 08.02.2022 | | 400 | 408 |
| CFLD Cayman Investment Ltd. 8,625 % fällig am 28.02.2021 | | 400 | 406 |
| Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 5,350 % fällig am 11.03.2024 | | 400 | 400 |
| Tencent Holdings Ltd. 3,595 % fällig am 19.01.2028 | | 400 | 400 |
| Export-Import Bank of India 3,875 % fällig am 01.02.2028 | | 400 | 400 |
| CK Hutchison International Ltd. 3,250 % fällig am 11.04.2024 | | 400 | 400 |
| Sri Lanka Government International Bond 7,850 % fällig am 14.03.2029 | | 400 | 400 |
| Chalieco Hong Kong Corp. Ltd. 5,700 % fällig am 15.01.2020 | | 400 | 400 |
| Horse Gallop Finance Ltd. 3,510 % fällig am 28.06.2021 | | 400 | 400 |
| NTPC Ltd. 3,750 % fällig am 03.04.2024 | | 400 | 400 |
| China Resources Land Ltd. 4,125 % fällig am 26.02.2029 | | 400 | 400 |
| Johnson Electric Holdings Ltd. 4,125 % fällig am 30.07.2024 | | 400 | 400 |
| Vedanta Resources Finance PLC 8,000 % fällig am 23.04.2023 | | 400 | 400 |
| Sinopec Group Overseas Development Ltd. 3,250 % fällig am 28.04.2025 | | 400 | 400 |
| China Cinda Finance Ltd. 4,100 % fällig am 09.03.2024 | | 400 | 400 |
| ICICI Bank Ltd. 3,250 % fällig am 09.09.2022 | | 400 | 399 |
| China Reinsurance Finance Corp. Ltd. 3,375 % fällig am 09.03.2022 | | 400 | 399 |
| GLP Pte. Ltd. 3,875 % fällig am 04.06.2025 | | 400 | 399 |
| China Railway Construction Corp. Ltd. 1,500 % fällig am 21.12.2021 | CNY | 2.000 | 399 |
| Yanlord Land HK Co. Ltd. 6,750 % fällig am 23.04.2023 | $ | 300 | 399 |
| Shinhan Financial Group Co. Ltd. 5,875 % fällig am 13.08.2023 | | 300 | 398 |
| Airport Authority Hong Kong 3,450 % fällig am 21.02.2029 | | 300 | 397 |
| GOME Retail Holdings Ltd. 5,000 % fällig am 10.03.2020 | | 300 | 397 |
| BDO Unibank, Inc. 2,950 % fällig am 06.03.2023 | | 300 | 396 |
| Wynn Macau Ltd. 4,875 % fällig am 01.10.2024 | | 300 | 396 |
| Medco Platinum Road 6,750 % fällig am 30.01.2025 | | 300 | 396 |
| Medco Oak Tree 7,375 % fällig am 14.05.2026 | | 300 | 396 |

(a) Der Emerging Asia 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Local Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 95.849.208 | $ 959.712 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028 | PEN | 292.100 | 95.847 |
| Russia Government International Bond 7,950 % fällig am 07.10.2026 | RUB | 5.094.800 | 78.377 |
| Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026 | PEN | 211.718 | 77.690 |
| Hungary Government International Bond 2,750 % fällig am 22.12.2026 | HUF | 19.982.200 | 69.530 |
| Colombian TES 7,750 % fällig am 18.09.2030 | COP | 183.533.800 | 62.184 |
| Hungary Government International Bond 1,500 % fällig am 24.08.2022 | HUF | 16.714.200 | 59.625 |
| South Africa Government International Bond 10,500 % fällig am 21.12.2026 | CAR | 595.300 | 45.679 |
| Colombian TES 6,000 % fällig am 28.04.2028 | COP | 124.512.400 | 38.024 |
| Colombian TES 10,000 % fällig am 24.07.2024 | | 94.748.000 | 35.682 |
| Peru Government International Bond 6,950 % fällig am 12.08.2031 | PEN | 94.200 | 32.146 |
| Mexico Government International Bond 8,000 % fällig am 07.12.2023 | MXN | 568.700 | 30.028 |
| Argentina Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.07.2020 | ARS | 1.258.300 | 28.404 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 259.708 | 26.356 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Romania Government International Bond 4,500 % fällig am 17.06.2024 | RON | 106.500 | 25.783 |
| Peru Government International Bond 6,150 % fällig am 12.08.2032 | PEN | 80.453 | 25.258 |
| Swiss Insured Brazil Power Finance SARL 9,850 % fällig am 16.07.2032 | BRL | 94.246 | 24.835 |
| South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030 | ZAR | 373.500 | 24.265 |
| Dominican Republic International Bond 9,750 % fällig am 05.06.2026 | DOP | 1.217.000 | 24.088 |
| Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 72.938 | 23.253 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 116.765.744 | $ 1.169.100 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Peru Government International Bond 8,2000 % fällig am 12.08.2026 | PEN | 204.718 | 75.221 |
| Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028 | | 161.300 | 54.011 |
| Colombian TES 10,000 % fällig am 24.07.2024 | COP | 94.748.000 | 35.703 |
| Mexico Government International Bond 8,500 % fällig am 31.05.2029 | MXN | 559.500 | 29.488 |
| Russia Government International Bond 7,400 % fällig am 07.12.2022 | RUB | 1.593.300 | 23.800 |
| Malaysia Government Bond 5,734 % fällig am 30.07.2019 | MYR | 92.500 | 22.160 |
| South Africa Government International Bond 7,000 % fällig am 28.02.2031 | ZAR | 328.700 | 19.504 |
| Poland Government International Bond 1,750 % fällig am 25.07.2021 | PLN | 69.300 | 18.627 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,500 % fällig am 01.03.2021 | CLP | 12.180.000 | 18.498 |
| South Africa Government International Bond 8,000 % fällig am 31.01.2030 | ZAR | 275.200 | 17.947 |
| South Africa Government International Bond 7,750 % fällig am 28.02.2023 | | 251.100 | 17.447 |
| Poland Government International Bond 5,750 % fällig am 25.10.2021 | PLN | 55.560 | 16.509 |
| Peru Government International Bond 6,950 % fällig am 12.08.2031 | PEN | 47.100 | 16.110 |
| Russia Government International Bond 8,150 % fällig am 03.02.2027 | RUB | 146.600 | 15.489 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 146.600 | 14.875 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Indonesia Treasury Bond 8,375 % fällig am 15.03.2034 | IDR | 197.658.000 | 14.534 |
| Argentina Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.07.2020 | ARS | 629.150 | 14.154 |
| Argentina Government International Bond 59,257 % fällig am 21.06.2020 | | 592.485 | 13.346 |
| Poland Government International Bond 2,250 % fällig am 25.04.2022 | PLN | 47.400 | 12.671 |

(a) Der Emerging Local Bond Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 97.860.108 | $ | 979.858 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** | | | | |
| 5,800 % fällig am 21.02.2022 | $ | 40.500 | | 40.535 |
| **Russia Government International Bond** | | | | |
| 5,100 % fällig am 28.03.2035 | | 38.600 | | 39.290 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | | |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 31.300 | | 31.300 |
| **Ecuador Government International Bond** | | | | |
| 10,750 % fällig am 31.01.2029 | | 26.400 | | 28.044 |
| **Argentina Government International Bond** | | | | |
| 7,125 % fällig am 06.07.2036 | | 33.800 | | 26.365 |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 1,500 % fällig am 26.06.2029 | € | 21.000 | | 23.296 |
| **Peru Government International Bond** | | | | |
| 6,950 % fällig am 12.08.2031 | PEN | 65.900 | | 22.389 |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 4,100 % fällig am 24.04.2028 | $ | 22.000 | | 22.079 |
| **Egypt Government International Bond** | | | | |
| 7,600 % fällig am 01.03.2029 | | 22.000 | | 22.000 |
| | | **AKTIEN** | | |
| **PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a)** | | 1.943.234 | | 20.000 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Ukraine Government International Bond** | | | | |
| 6,750 % fällig am 20.06.2026 | € | 17.400 | | 19.614 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 4,817 % fällig am 14.03.2049 | $ | 18.900 | | 18.900 |
| **Qatar Government International Bond** | | | | |
| 4,000 % fällig am 14.03.2029 | | 18.900 | | 18.834 |
| **Southern Gas Corridor CJSC** | | | | |
| 6,875 % fällig am 24.03.2026 | | 16.800 | | 18.689 |
| **Ghana Government International Bond** | | | | |
| 8,950 % fällig am 26.03.2051 | | 18.100 | | 18.100 |
| **Celestial Dynasty Ltd.** | | | | |
| 4,250 % fällig am 27.06.2029 | | 17.700 | | 17.650 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 17.400 | | 17.400 |
| **MAF Sukuk Ltd.** | | | | |
| 4,638 % fällig am 14.05.2029 | | 17.400 | | 17.400 |
| **Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais** | | | | |
| 5,333 % fällig am 15.02.2028 | | 16.830 | | 17.186 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 104.218.516 | $ | 1.043.500 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| **Serbia Government International Bond** | | | | |
| 4,875 % fällig am 25.02.2020 | $ | 21.941 | | 22.202 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 15.900 | | 15.806 |
| **SASOL Financing USA LLC** | | | | |
| 5,875 % fällig am 27.03.2024 | | 14.300 | | 15.216 |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 4,750 % fällig am 11.02.2029 | | 13.800 | | 14.400 |
| **U.S. Treasury Bonds** | | | | |
| 3,375 % fällig am 15.11.2048 | | 13.300 | | 14.094 |
| **Indonesia Government International Bond** | | | | |
| 4,450 % fällig am 11.02.2024 | | 12.600 | | 13.167 |
| **Export-Import Bank of India** | | | | |
| 3,875 % fällig am 01.02.2028 | | 13.000 | | 13.117 |
| **LLPL Capital Pte Ltd.** | | | | |
| 6,875 % fällig am 04.02.2039 | | 10.800 | | 12.274 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | | |
| 3,250 % fällig am 13.09.2027 | | 12.500 | | 12.164 |
| **Republic of Poland Government International Bond** | | | | |
| 3,250 % fällig am 06.04.2026 | | 11.500 | | 11.880 |
| **Vnesheconombank Via VEB Finance PLC** | | | | |
| 6,902 % fällig am 09.07.2020 | | 10.600 | | 10.742 |
| **Bank Mandiri Persero Tbk PT** | | | | |
| 3,750 % fällig am 11.04.2024 | | 10.500 | | 10.426 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,885 % fällig am 12.02.2020 | | 9.200 | | 9.249 |
| **Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A.** | | | | |
| 5,999 % fällig am 23.01.2021 | | 8.780 | | 9.149 |
| **Vigorous Champion International Ltd.** | | | | |
| 3,625 % fällig am 28.05.2024 | | 9.000 | | 9.144 |
| **Petronas Capital Ltd.** | | | | |
| 5,250 % fällig am 12.08.2019 | | 8.200 | | 8.248 |
| **Rosneft Finance S.A.** | | | | |
| 7,250 % fällig am 02.02.2020 | | 8.000 | | 8.200 |
| **U.S. Treasury Notes** | | | | |
| 2,375 % fällig am 29.02.2024 | | 8.200 | | 8.153 |
| **QNB Finance Ltd.** | | | | |
| 3,915 % fällig am 07.02.2020 | | 7.900 | | 7.944 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Corporate Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 5.365.613 | $ 53.723 |
| MMK International Capital DAC 4,375 % fällig am 13.06.2024 | $ | 3.500 | 3.521 |
| Eastern & Southern African Trade & Development Bank 4,875 % fällig am 23.05.2024 | | 3.100 | 3.083 |
| Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. 6,000 % fällig am 27.11.2023 | | 2.600 | 2.741 |
| Petrobras Global Finance BV 4,750 % fällig am 14.01.2025 | € | 2.200 | 2.728 |
| QNB Finansbank A/S 6,875 % fällig am 07.09.2024 | $ | 2.600 | 2.591 |
| Export Credit Bank of Turkey 8,250 % fällig am 24.01.2024 | | 2.500 | 2.495 |
| Ukraine Government International Bond 6,750 % fällig am 20.06.2026 | € | 2.100 | 2.367 |
| ADES International Holding PLC 8,625 % fällig am 24.04.2024 | $ | 2.300 | 2.300 |
| Gran Tierra Energy, Inc. 7,750 % fällig am 23.05.2027 | | 2.100 | 2.069 |
| Bioceanico Sovereign Certificate Ltd. 0,000 % fällig am 05.06.2034 | | 3.200 | 2.036 |
| CSN Resources S.A. 7,625 % fällig am 13.02.2023 | | 2.000 | 2.024 |
| JBS Investments II GmbH 7,000 % fällig am 15.01.2026 | | 1.900 | 1.929 |
| Kosmos Energy Ltd. 7,125 % fällig am 04.04.2026 | | 1.900 | 1.900 |
| Eurochem Finance DAC 5,500 % fällig am 13.03.2024 | | 1.800 | 1.800 |
| Braskem Finance Ltd. 6,450 % fällig am 03.02.2024 | | 1.600 | 1.722 |
| International Airport Finance S.A. 12,000 % fällig am 15.03.2033 | | 1.700 | 1.700 |
| Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S 6,950 % fällig am 14.03.2026 | | 1.700 | 1.672 |
| ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 5,450 % fällig am 24.01.2028 | | 1.900 | 1.645 |
| African Export-Import Bank 4,125 % fällig am 20.06.2024 | | 1.700 | 1.626 |
| ADCB Finance Cayman Ltd. 4,000 % fällig am 29.03.2023 | | 1.600 | 1.594 |
| Ukraine Government International Bond 0,000 % fällig am 31.05.2040 | | 2.500 | 1.557 |
| Vedanta Resources Finance PLC 8,000 % fällig am 23.04.2023 | | 1.500 | 1.500 |
| Turk Telekomunikasyon A/S 6,875 % fällig am 28.02.2025 | | 1.500 | 1.491 |
| U. S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.05.2045 | | 1.400 | 1.482 |
| Votorantim Cimentos International S.A. 7,250 % fällig am 05.04.2041 | | 1.200 | 1.269 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc – PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 5.733.444 | $ 57.400 |
| JBS Investments GmbH 7,000 % fällig am 15.01.2026 | $ | 3.100 | 3.269 |
| Sberbank of Russia Via SB Capital S.A. 5,500 % fällig am 26.02.2024 | | 3.200 | 3.200 |
| HPHT Finance Ltd. 2,750 % fällig am 11.09.2022 | | 2.300 | 2.255 |
| SASOL Financing USA LLC 5,875 % fällig am 27.03.2024 | | 1.800 | 1.913 |
| Country Garden Holdings Co. Ltd. 7,125 % fällig am 27.01.2022 | | 1.800 | 1.870 |
| Indo Energy Finance BV 6,375 % fällig am 24.01.2023 | | 1.600 | 1.561 |
| Promerica Financial Corp. 9,700 % fällig am 14.05.2024 | | 1.350 | 1.414 |
| YPF S.A. 8,750 % fällig am 04.04.2024 | | 1.400 | 1.398 |
| C&W Senior Financing DAC 7,500 % fällig am 15.10.2026 | | 1.400 | 1.386 |
| CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 4,625 % fällig am 14.03.2023 | | 1.300 | 1.320 |
| Champion Sincerity Holdings Ltd. 8,125 % fällig am 02.08.2022 | | 1.200 | 1.240 |
| Banco BTG Pactual S.A. 5,500 % fällig am 31.01.2023 | | 1.200 | 1.213 |
| Sinopec Group Overseas Development Ltd. 4,125 % fällig am 12.09.2025 | | 1.200 | 1.211 |
| Ukraine Government International Bond 7,750 % fällig am 01.09.2021 | | 1.100 | 1.128 |
| Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd. 5,838 % fällig am 30.09.2027 | | 1.000 | 1.102 |
| China Evergrande Group 4,250 % fällig am 14.02.2023 | HKD | 9.000 | 1.084 |
| Petrobras Global Finance BV 5,999 % fällig am 27.01.2028 | $ | 1.035 | 1.032 |
| Yanlord Land HK Co. Ltd. 6,750 % fällig am 23.04.2023 | | 1.000 | 1.018 |
| Ghana Government International Bond 8,950 % fällig am 26.03.2051 | | 1.000 | 1.015 |
| Sinopec Group Overseas Development Ltd. 3,900 % fällig am 17.05.2022 | | 1.000 | 1.009 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| **Peruvian Government International Bond** | | | |
| 8,200 % fällig am 08.12.2026 | PEN | 39.200 | $ 14.257 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 118.400 | 12.015 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | |
| 54,515 % fällig am 31.05.2022 | ARS | 230.000 | 4.175 |
| **Ukraine Government International Bond** | | | |
| 0,000 % fällig am 06.05.2021 | $ | 6.000 | 3.780 |
| **VMware, Inc.** | | | |
| 2,950 % fällig am 10.05.2034 | | 2.600 | 2.591 |
| **Argentina Treasury Bill** | | | |
| 0,000 % fällig am 31.07.2020 | ARS | 113.380 | 2.559 |
| **Daimler Finance North America LLC** | | | |
| 3,400 % fällig am 22.02.2022 | $ | 2.500 | 2.556 |
| **Guatemala Government Bond** | | | |
| 5,750 % fällig am 06.06.2022 | | 2.400 | 2.544 |
| **Dominican Republic International Bond** | | | |
| 7,500 % fällig am 06.05.2021 | | 2.400 | 2.530 |
| **Reynolds American, Inc.** | | | |
| 3,250 % fällig am 12.06.2020 | | 2.509 | 2.523 |
| **Broadcom, Inc.** | | | |
| 3,125 % fällig am 15.04.2021 | | 2.500 | 2.508 |
| **Hrvatska Elektroprivreda** | | | |
| 5,875 % fällig am 23.10.2022 | | 2.300 | 2.493 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | |
| 2,250 % fällig am 13.01.2020 | | 2.500 | 2.491 |
| **Marathon Oil Corp.** | | | |
| 2,800 % fällig am 01.11.2022 | | 2.500 | 2.491 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | |
| 3,700 % fällig am 19.03.2023 | | 2.400 | 2.474 |
| **Petrobras Global Finance BV** | | | |
| 6,125 % fällig am 17.01.2022 | | 2.300 | 2.461 |
| **Air Lease Corp.** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.01.2022 | | 2.400 | 2.450 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** | | | |
| 3,500 % fällig am 15.07.2022 | | 2.400 | 2.447 |
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | | 2.400 | 2.425 |
| **Telefonica Emisiones S.A.** | | | |
| 5,462 % fällig am 16.02.2021 | | 2.300 | 2.408 |
| **Navient Corp.** | | | |
| 6,500 % fällig am 15.06.2022 | | 2.300 | 2.404 |
| **CVS Health Corp.** | | | |
| 2,800 % fällig am 20.07.2020 | | 2.400 | 2.403 |
| **United Technologies Corp.** | | | |
| 3,175 % fällig am 16.08.2021 | | 2.400 | 2.402 |
| **MGM Resorts International** | | | |
| 6,750 % fällig am 01.10.2020 | | 2.300 | 2.401 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | |
| 3,169 % fällig am 19.03.2021 | | 2.400 | 2.400 |
| **Sprint Communications, Inc.** | | | |
| 7,000 % fällig am 15.08.2020 | | 2.300 | 2.386 |
| **Sempra Energy** | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | | 2.400 | 2.386 |
| **American Tower Corp.** | | | |
| 2,250 % fällig am 15.01.2022 | | 2.400 | 2.377 |
| **Dell International LLC** | | | |
| 4,420 % fällig am 15.06.2021 | | 2.300 | 2.363 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** | | | |
| 5,139 % fällig am 07.01.2021 | | 2.300 | 2.345 |
| **DISH DBS Corp.** | | | |
| 5,125 % fällig am 01.05.2020 | | 2.300 | 2.323 |
| **Incitec Pivot Finance LLC** | | | |
| 6,000 % fällig am 10.12.2019 | | 2.267 | 2.300 |
| **GE Capital International Funding Co. Unlimited Co.** | | | |
| 2,342 % fällig am 15.11.2020 | | 2.100 | 2.084 |
| **Russian Federal Bond - OFZ** | | | |
| 7,250 % fällig am 10.05.2034 | RUB | 142.200 | 2.061 |
| **Accredited Mortgage Loan Trust** | | | |
| 2,664 % fällig am 25.09.2036 | $ | 1.459 | 1.432 |
| **Sunac China Holdings Ltd.** | | | |
| 7,250 % fällig am 14.06.2022 | | 1.300 | 1.292 |
| **Perusahaan Listrik Negara PT** | | | |
| 5,500 % fällig am 22.11.2021 | | 1.200 | 1.271 |
| **Pertamina Persero PT** | | | |
| 4,875 % fällig am 03.05.2022 | | 1.200 | 1.263 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| **Peruvian Government International Bond** | | | |
| 8,200 % fällig am 12.08.2026 | PEN | 19.700 | $ 7.292 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 37.900 | 3.845 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **CVS Health Corp.** | | | |
| 2,800 % fällig am 20.07.2020 | $ | 2.400 | 2.404 |
| **Zimmer Biomet Holdings, Inc.** | | | |
| 3,169 % fällig am 19.03.2021 | | 2.400 | 2.397 |
| **Argentina Treasury Bill** | | | |
| 0,000 % fällig am 31.07.2020 | ARS | 56.690 | 1.275 |
| **Turkiye Garanti Bankasi A/S** | | | |
| 5,250 % fällig am 13.09.2022 | $ | 300 | 293 |
| **Akbank T.A.S** | | | |
| 5,000 % fällig am 26.09.2019 | | 300 | 289 |
| **Export Credit Bank of Turkey** | | | |
| 4,250 % fällig am 18.09.2022 | | 300 | 279 |
| **Alfa Bank (Alfa Bond)** | | | |
| 7,500 % fällig am 26.09.2019 | | 200 | 202 |
| **Provincia de Buenos Aires** | | | |
| 54,515 % fällig am 31.05.2022 | ARS | 9.270 | 176 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 1.171.448 | $ 11.728 |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 39.912 | 4.047 |
| | | PARI (000S) | |
| Peru Government International Bond 8,200 % fällig am 12.08.2026 | PEN | 6.100 | 2.216 |
| Hungary Government International Bond 2,500 % fällig am 27.10.2021 | HUF | 383.200 | 1.379 |
| Hungary Government International Bond 1,500 % fällig am 24.08.2022 | | 317.600 | 1.105 |
| Swiss Insured Brazil Power Finance SARL 9,850 % fällig am 16.07.2032 | BRL | 3.300 | 860 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 0,000 % fällig am 20.10.2051 | £ | 600 | 793 |
| Argentina Treasury Bills 0,000 % fällig am 31.07.2020 | ARS | 35.100 | 792 |
| Malaysia Government Bond 5,734 % fällig am 30.07.2019 | MYR | 1.800 | 446 |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 2,574 % fällig am 25.10.2036 | $ | 425 | 409 |
| Dominican Republic International Bond 9,750 % fällig am 05.06.2026 | DOP | 19.800 | 401 |
| Nissan Motor Acceptance Corp. 3,487 % fällig am 13.01.2022 | $ | 400 | 400 |
| FBR Securitization Trust 3,109 % fällig am 25.11.2035 | | 400 | 389 |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 2,784 % fällig am 25.12.2035 | | 350 | 343 |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 300 | 300 |
| Argentina Treasury Bond 2,250 % fällig am 28.04.2020 | ARS | 7.200 | 288 |
| Bear Stearns ALT-A Trust 3,738 % fällig am 25.04.2037 | $ | 291 | 254 |
| Volkswagen Leasing GmbH 2,375 % fällig am 06.09.2022 | € | 200 | 237 |
| Pernod Ricard S.A. 5,750 % fällig am 07.04.2021 | $ | 200 | 210 |
| Dell International LLC 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 200 | 210 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 1.166.761 | $ 11.683 |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 30.100 | 3.050 |
| | | PARI (000S) | |
| DBS Group Holdings Ltd. 2,943 % fällig am 08.06.2020 | $ | 750 | 752 |
| Malaysia Government Bond 5,734 % fällig am 30.07.2019 | MYR | 1.800 | 431 |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2,938 % fällig am 17.01.2020 | $ | 300 | 301 |
| Argentina Government International Bond 63,705 % fällig am 21.06.2020 | ARS | 12.244 | 275 |
| Petronas Capital Ltd. 5,250 % fällig am 12.08.2019 | $ | 200 | 201 |
| Argentina Government International Bond 52,006 % fällig am 03.04.2022 | ARS | 6.070 | 116 |
| Bank of America Corp. 0,000 % fällig am 21.10.2025 | MXN | 1.000 | 68 |
| Banco Santander Mexico S.A. 25,500 % fällig am 17.07.2019 | ARS | 1.500 | 30 |
| Banco de Galicia y Buenos Aires S.A. 25,980 % fällig am 26.04.2020 | | 1.000 | 15 |
| Provincia de Buenos Aires 54,501 % fällig am 12.04.2025 | | 300 | 6 |
| Provincia de Buenos Aires 54,515 % fällig am 31.05.2022 | | 160 | 3 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Bond Fund



| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | € | 761.500 | 76.296 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.04.2020 | DKK | 431.000 | 58.572 |
| **Spain Government International Bond** 1,400 % fällig am 30.07.2028 | € | 38.800 | 42.597 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b) | $ | 39.689 | 35.786 |
| **Spain Government International Bond** 1,450 % fällig am 30.04.2029 | € | 35.800 | 35.760 |
| **France Government International Bond** 1,500 % fällig am 25.05.2050 | | 34.700 | 33.776 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 215.000 | 28.608 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | $ | 27.070 | 24.560 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,000 % fällig am 01.01.2020 | DKK | 150.700 | 20.427 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** 0,125 % fällig am 17.10.2023 | € | 17.200 | 17.486 |
| **CVC Cordatus Loan Fund Ltd.** 0,970 % fällig am 22.04.2030 | | 15.900 | 15.900 |
| **Jyske Realkredit A/S** 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 81.700 | 10.956 |
| **Natwest Markets PLC** 0,080 % fällig am 02.03.2020 | € | 10.760 | 10.759 |
| **Deposit Insurance Corp. of Japan** 0,100 % fällig am 17.01.2020 | ¥ | 1.300.000 | 10.628 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 0,000 % fällig am 04.07.2024 | € | 9.700 | 9.858 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 7.900 | 9.256 |
| **Morgan Stanley** 0,392 % fällig am 08.11.2022 | € | 9.100 | 9.147 |
| **Tikehau CLO BV** 0,000 % fällig am 07.12.2029 | | 8.900 | 8.900 |
| **SapphireOne Mortgages FCT** 0,156 % fällig am 27.06.2061 | | 8.252 | 8.295 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 0,750 % fällig am 15.01.2029 | | 7.800 | 7.799 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 0,000 % fällig am 02.04.2024 | | 7.600 | 7.595 |
| **Dexia Credit Local S.A.** 0,000 % fällig am 29.05.2024 | | 7.600 | 7.590 |
| **Paragon Mortgages PLC** 0,000 % fällig am 15.05.2045 | £ | 6.800 | 7.578 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** 0,400 % fällig am 26.01.2026 | € | 7.500 | 7.467 |
| **Accunia European CLO BV** 0,950 % fällig am 15.07.2030 | | 7.300 | 7.300 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | € | 228.000 | 22.810 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b) | $ | 23.385 | 22.782 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** 0,200 % fällig am 17.01.2024 | € | 21.900 | 22.095 |
| **ING Bank NV** 2,625 % fällig am 05.12.2022 | $ | 21.199 | 19.015 |
| **Spain Government International Bond** 1,450 % fällig am 30.04.2029 | € | 12.500 | 12.639 |
| **Nykredit Realkredit A/S** 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 85.771 | 11.823 |
| **Bpifrance Financement S.A.** 1,000 % fällig am 25.10.2019 | € | 11.400 | 11.461 |
| **Realkredit Danmark A/S** 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 79.339 | 10.943 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 0,750 % fällig am 15.01.2029 | € | 7.800 | 7.980 |
| **Europäische Finanzstabilisierungsfazilität** 0,400 % fällig am 26.01.2026 | | 7.500 | 7.533 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 0,125 % fällig am 07.11.2023 | | 4.700 | 4.787 |
| **Province of Ontario** 2,500 % fällig am 10.09.2021 | $ | 5.000 | 4.482 |
| **Development Bank of Japan, Inc.** 1,625 % fällig am 01.09.2021 | | 4.500 | 3.946 |
| **Land Nordrhein-Westfalen** 0,900 % fällig am 15.11.2028 | € | 3.500 | 3.677 |
| **LeasePlan Corp. NV** 1,000 % fällig am 08.04.2020 | | 3.600 | 3.636 |
| **Dexia Credit Local S.A.** 1,875 % fällig am 15.09.2021 | $ | 3.900 | 3.441 |
| **Europäische Investitionsbank** 0,625 % fällig am 22.01.2029 | € | 3.300 | 3.273 |
| **Kreditanstalt fuer Wiederaufbau** 0,000 % fällig am 02.04.2024 | | 3.000 | 3.037 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 19.486 | 2.688 |
| **Volkswagen Financial Services AG** 0,040 % fällig am 11.10.2019 | € | 2.500 | 2.502 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK | 17.500 | 2.357 |
| **Wind Tre SpA** 3,125 % fällig am 20.01.2025 | € | 2.400 | 2.307 |
| **Japan Bank for International Cooperation** 2,000 % fällig am 04.11.2021 | $ | 2.600 | 2.302 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Credit Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 1.778.000 | € 178.177 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Nykredit Realkredit A/S<br>1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 114.600 | 15.079 |
| BNP Paribas S.A.<br>4,705 % fällig am 10.01.2025 | $ | 11.600 | 10.841 |
| UniCredit Bank AG<br>1,875 % fällig am 05.07.2022 | | 11.000 | 9.636 |
| Credit Suisse Group AG<br>2,997 % fällig am 14.12.2023 | | 9.400 | 8.316 |
| Spain Government International Bond<br>1,450 % fällig am 30.04.2029 | € | 8.100 | 8.197 |
| Dell International LLC<br>4,000 % fällig am 15.07.2024 | $ | 7.600 | 6.686 |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab<br>1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 49.500 | 6.562 |
| Volkswagen Financial Services AG<br>0,875 % fällig am 12.04.2023 | € | 6.100 | 5.978 |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>1,375 % fällig am 15.05.2024 | | 5.700 | 5.707 |
| Deutsche Bank AG<br>3,375 % fällig am 12.05.2021 | $ | 6.300 | 5.357 |
| BAT International Finance PLC<br>3,950 % fällig am 15.06.2025 | | 5.430 | 4.519 |
| Fannie Mae<br>3,500 % fällig am 01.06.2049 | | 5.000 | 4.476 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC<br>2,000 % fällig am 08.03.2023 | € | 4.100 | 4.217 |
| CVC Cordatus Loan Fund Ltd.<br>0,970 % fällig am 22.04.2030 | | 4.200 | 4.200 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC<br>1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 3.400 | 3.984 |
| Syngenta Finance NV<br>4,892 % fällig am 24.04.2025 | $ | 4.500 | 3.898 |
| Eutelsat S.A.<br>2,250 % fällig am 13.07.2027 | € | 3.800 | 3.793 |
| Volkswagen Leasing GmbH<br>2,625 % fällig am 15.01.2024 | | 3.500 | 3.622 |
| Toronto-Dominion Bank<br>0,375 % fällig am 25.04.2024 | | 3.400 | 3.405 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 1.408.000 | € 141.071 |
| | | **PARI (000S)** | |
| BNP Paribas S.A.<br>1,000 % fällig am 27.06.2024 | € | 9.800 | 9.989 |
| Spain Government International Bond<br>1,450 % fällig am 30.04.2029 | | 8.100 | 8.464 |
| Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.<br>1,250 % fällig am 14.04.2022 | | 8.100 | 8.352 |
| Cooperatieve Rabobank UA<br>6,875 % fällig am 19.03.2020 | | 5.400 | 5.725 |
| BAT International Finance PLC<br>2,750 % fällig am 25.03.2025 | | 5.430 | 5.709 |
| Goldman Sachs Group, Inc.<br>2,000 % fällig am 22.03.2028 | | 5.700 | 5.698 |
| Volkswagen Financial Services AG<br>0,875 % fällig am 12.04.2023 | | 5.500 | 5.547 |
| Aptiv PLC<br>1,500 % fällig am 10.03.2025 | | 5.200 | 5.379 |
| Deutsche Bank AG<br>1,125 % fällig am 30.08.2023 | | 5.300 | 5.343 |
| Fannie Mae<br>3,500 % fällig am 01.06.2049 | $ | 5.000 | 4.564 |
| Swedbank Hypotek AB<br>3,750 % fällig am 19.06.2019 | SEK | 36.000 | 3.529 |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB<br>3,000 % fällig am 19.06.2019 | | 36.000 | 3.512 |
| Lansforsakringar Hypotek AB<br>2,500 % fällig am 19.06.2019 | | 36.000 | 3.509 |
| Natwest Markets PLC<br>0,625 % fällig am 02.03.2022 | € | 3.500 | 3.503 |
| Volkswagen International Finance NV<br>1,234 % fällig am 16.11.2024 | | 3.500 | 3.492 |
| JPMorgan Chase & Co.<br>4,500 % fällig am 24.01.2022 | $ | 3.778 | 3.434 |
| Volkswagen Bank GmbH<br>0,377 % fällig am 08.12.2021 | € | 3.100 | 3.109 |
| Eutelsat S.A.<br>2,000 % fällig am 02.10.2025 | | 3.000 | 3.006 |
| Toyota Finance Australia Ltd.<br>0,500 % fällig am 06.04.2023 | | 2.700 | 2.735 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Income Bond Fund



| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 2.884.400 € | 289.016 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Nykredit Realkredit A/S** 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 435.900 | 57.617 |
| **Spain Government International Bond** 1,450 % fällig am 30.04.2029 | € | 48.500 | 49.395 |
| **Jyske Realkredit A/S** 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 232.200 | 30.856 |
| **UniCredit SpA** 6,572 % fällig am 14.01.2022 | $ | 27.750 | 25.111 |
| **Nordea Kredit Realkreditaktieselskab** 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 175.300 | 23.344 |
| **UniCredit Bank AG** 1,875 % fällig am 05.07.2022 | $ | 25.000 | 21.899 |
| **BNP Paribas S.A.** 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 23.200 | 21.664 |
| **Indonesia Government International Bond** 3,375 % fällig am 30.07.2025 | € | 15.400 | 17.296 |
| **Altice Luxembourg S.A.** 8,000 % fällig am 15.05.2027 | | 16.300 | 16.300 |
| **Altice Luxembourg S.A.** 7,250 % fällig am 15.05.2022 | | 12.550 | 12.757 |
| **Ingenico Group S.A.** 1,625 % fällig am 13.09.2024 | | 11.900 | 11.656 |
| **Volkswagen Leasing GmbH** 2,625 % fällig am 15.01.2024 | | 11.200 | 11.591 |
| **Romania Government International Bond** 2,000 % fällig am 08.12.2026 | | 10.900 | 10.926 |
| **Banca Monte dei Paschi di Siena SpA** 2,000 % fällig am 29.01.2024 | | 10.300 | 10.543 |
| **Russia Government International Bond** 2,875 % fällig am 04.12.2025 | | 10.000 | 10.413 |
| **Santander UK Group Holdings PLC** 0,505 % fällig am 27.03.2024 | | 10.000 | 9.825 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 1,375 % fällig am 15.05.2024 | | 9.300 | 9.313 |
| **Lincoln Financing SARL** 3,875 % fällig am 01.04.2024 | | 8.900 | 8.944 |
| **Deutsche Bank AG** 1,875 % fällig am 14.02.2022 | | 8.900 | 8.883 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| **PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a)** | | 900.000 € | 90.113 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Spain Government International Bond** 1,450 % fällig am 30.04.2029 | € | 48.500 | 50.665 |
| **BNP Paribas S.A.** 1,000 % fällig am 27.06.2024 | | 19.200 | 19.570 |
| **Altice Luxembourg S.A.** 8,000 % fällig am 15.05.2027 | | 16.300 | 16.218 |
| **Cooperatieve Rabobank UA** 6,875 % fällig am 19.03.2020 | | 10.500 | 11.133 |
| **Volkswagen International Finance NV** 1,239 % fällig am 16.11.2024 | | 11.000 | 10.974 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** 2,000 % fällig am 01.11.2028 | | 9.400 | 9.338 |
| **Volkswagen Financial Services AG** 0,875 % fällig am 12.04.2023 | | 8.200 | 8.271 |
| **Crown European Holdings S.A.** 3,375 % fällig am 15.05.2025 | | 7.100 | 7.601 |
| **Faurecia S.A.** 2,625 % fällig am 15.06.2025 | | 6.800 | 6.827 |
| **Altice Luxembourg S.A.** 7,750 % fällig am 15.05.2022 | $ | 7.500 | 6.591 |
| **CVS Health Corp.** 3,700 % fällig am 09.03.2023 | | 6.700 | 5.960 |
| **Inmobiliaria Colonial Socimi S.A.** 2,728 % fällig am 05.06.2023 | € | 5.400 | 5.893 |
| **Daimler International Finance BV** 0,625 % fällig am 27.02.2023 | | 5.700 | 5.784 |
| **Altran Technologies S.A.** 3,000 % fällig am 20.03.2025 | | 5.230 | 5.217 |
| **Netflix, Inc.** 3,875 % fällig am 15.11.2029 | | 5.000 | 5.169 |
| **CPI Property Group S.A.** 4,875 % fällig am 16.07.2025 | | 5.200 | 4.830 |
| **Stadshypotek AB** 2,500 % fällig am 18.09.2019 | SEK | 47.000 | 4.615 |
| **Lansforsakringar Hypotek AB** 2,500 % fällig am 19.06.2019 | | 47.000 | 4.581 |
| **Nordea Hypotek AB** 2,250 % fällig am 19.06.2019 | | 47.000 | 4.580 |
| **Swedbank Hypotek AB** 3,750 % fällig am 19.06.2019 | | 46.000 | 4.509 |
| **Skandinaviska Enskilda Banken AB** 3,000 % fällig am 19.06.2019 | | 46.000 | 4.488 |
| **Sveriges Sakerstallda Obligationer AB** 4,000 % fällig am 18.09.2019 | | 45.000 | 4.460 |
| **Akelius Residential Property AB** 1,500 % fällig am 23.01.2022 | € | 4.200 | 4.265 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Long Average Duration Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 466 | € 46.697 |
| | | **PARI (000S)** | |
| France Government International Bond 4,500 % fällig am 25.04.2041 | € | 4.800 | 7.661 |
| France Government International Bond 1,500 % fällig am 25.05.2050 | | 7.000 | 7.324 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 7.028 | 6.471 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | | 5.414 | 4.912 |
| Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.06.2049 | | 5.000 | 4.476 |
| Belgium Government International Bond 1,700 % fällig am 22.06.2050 | € | 3.800 | 3.842 |
| Bundesrepublik Deutschland 2,500 % fällig am 15.08.2046 | | 2.400 | 3.392 |
| BNG Bank NV 1,500 % fällig am 29.03.2038 | | 3.000 | 3.143 |
| Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 17.500 | 2.350 |
| Jyske Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 14.900 | 1.974 |
| Syndicat Transport Ile de France EPA 1,000 % fällig am 25.05.2034 | € | 1.900 | 1.868 |
| Deposit Insurance Corp. of Japan 0,100 % fällig am 17.01.2020 | ¥ | 200.000 | 1.635 |
| Region Wallonne Belgium 1,250 % fällig am 03.05.2034 | € | 1.400 | 1.400 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 04.07.2024 | | 1.200 | 1.219 |
| Belgium Government International Bond 1,450 % fällig am 22.06.2037 | | 1.100 | 1.130 |
| Slovakia Government International Bond 2,000 % fällig am 17.10.2047 | | 1.100 | 1.130 |
| Tikehau CLO BV 0,880 % fällig am 07.12.2029 | | 1.100 | 1.100 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 900 | 1.055 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 7.700 | 1.018 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 324.000 | € 32.452 |
| | | **PARI (000S)** | |
| France Government International Bond 2,000 % fällig am 25.05.2048 | € | 6.900 | 7.838 |
| Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.06.2049 | $ | 5.000 | 4.564 |
| Belgium Government International Bond 1,700 % fällig am 22.06.2050 | € | 3.800 | 4.319 |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,250 % fällig am 24.05.2033 | | 3.300 | 3.513 |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,200 % fällig am 17.01.2024 | | 3.100 | 3.128 |
| Realkredit Danmark A/S 2,000 % fällig am 01.10.2047 | DKK | 19.593 | 2.702 |
| Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2047 | | 19.425 | 2.680 |
| AT&T, Inc. 3,547 % fällig am 15.07.2021 | $ | 2.700 | 2.418 |
| France Government International Bond 4,500 % fällig am 25.04.2041 | € | 1.200 | 2.143 |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,750 % fällig am 17.07.2053 | | 1.800 | 1.896 |
| Nykredit Realkredit A/S 2,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 10.000 | 1.379 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 1.472 | 1.370 |
| Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.01.2020 | DKK | 10.000 | 1.351 |
| ING Bank NV 2,625 % fällig am 05.12.2022 | $ | 1.400 | 1.262 |
| Slovakia Government International Bond 2,000 % fällig am 17.10.2047 | € | 1.100 | 1.196 |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 1,450 % fällig am 05.09.2040 | | 1.100 | 1.137 |
| France Government International Bond 1,750 % fällig am 25.05.2066 | | 900 | 1.096 |
| Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK | 8.100 | 1.090 |
| Belgium Government International Bond 1,600 % fällig am 22.06.2047 | € | 1.000 | 1.040 |
| Crown European Holdings S.A. 2,875 % fällig am 01.02.2026 | | 1.000 | 1.036 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 2,000 % fällig am 04.03.2025 | | 1.000 | 1.024 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,750 % fällig am 15.01.2029 | | 1.000 | 1.024 |
| United Technologies Corp. 1,000 % fällig am 18.05.2020 | | 1.000 | 1.001 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Low Duration Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 277.500 | € 27.793 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Autonomous Community of Madrid 0,747 % fällig am 30.04.2022 | € | 5.300 | 5.430 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 30.06.2022 | | 5.000 | 5.046 |
| Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 0,870 % fällig am 18.01.2030 | | 4.450 | 4.450 |
| Europäischer Stabilitätsmechanismus 0,100 % fällig am 03.11.2020 | | 4.200 | 4.239 |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,100 % fällig am 19.01.2021 | | 4.200 | 4.236 |
| Banco Santander S.A. 0,875 % fällig am 28.09.2021 | | 4.100 | 4.190 |
| Credit Suisse AG 0,750 % fällig am 17.09.2021 | | 4.100 | 4.181 |
| Dexia Credit Local S.A. 2,000 % fällig am 22.01.2021 | | 4.000 | 4.169 |
| PKO Bank Hipoteczny S.A. 0,250 % fällig am 23.11.2021 | | 4.100 | 4.118 |
| Lloyds Bank PLC 0,500 % fällig am 22.07.2020 | | 4.000 | 4.038 |
| AT&T, Inc. 2,650 % fällig am 17.12.2021 | | 3.700 | 3.935 |
| JAB Holdings BV 1,500 % fällig am 24.11.2021 | | 3.800 | 3.916 |
| Hamburg Commercial Bank AG 0,250 % fällig am 25.04.2022 | | 3.800 | 3.852 |
| Telefonica Emisiones S.A. 1,477 % fällig am 14.09.2021 | | 3.500 | 3.620 |
| Dryden Euro CLO BV 0,880 % fällig am 15.01.2030 | | 3.500 | 3.500 |
| Volkswagen Leasing GmbH 0,500 % fällig am 20.06.2022 | | 3.500 | 3.490 |
| Banca Carige SpA 1,389 % fällig am 25.10.2021 | | 3.400 | 3.433 |
| Lloyds Bank PLC 1,375 % fällig am 16.04.2021 | | 3.300 | 3.397 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 3,600 % fällig am 26.02.2021 | | 3.200 | 3.380 |
| UBS AG 4,000 % fällig am 08.04.2022 | | 3.000 | 3.360 |
| KOFIBA-Kommunalfinanzierungsbank GmbH 0,375 % fällig am 03.03.2022 | | 3.300 | 3.360 |
| Danske Bank A/S 0,125 % fällig am 14.02.2022 | | 3.300 | 3.335 |
| Yorkshire Building Society 0,750 % fällig am 10.11.2022 | | 3.200 | 3.301 |
| Santander UK PLC 4,250 % fällig am 12.04.2021 | | 3.000 | 3.280 |
| Syngenta Finance NV 1,875 % fällig am 02.11.2021 | | 3.000 | 3.096 |
| Japan Finance Organization for Municipalities 0,875 % fällig am 22.09.2021 | | 3.000 | 3.075 |
| Arbour CLO DAC 0,870 % fällig am 15.01.2030 | | 3.000 | 3.000 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.01.2020 | DKK | 21.500 | 2.913 |
| Hutchison Whampoa Finance Ltd. 1,375 % fällig am 31.10.2021 | € | 2.600 | 2.682 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.07.2020 | DKK | 19.400 | 2.644 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 2.200 | 2.578 |
| SapphireOne Mortgages FCT 0,156 % fällig am 27.06.2061 | € | 2.373 | 2.386 |
| GE Capital European Funding Unlimited Co. 4,350 % fällig am 03.11.2021 | | 2.200 | 2.379 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 288.800 | € 28.942 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,100 % fällig am 19.01.2021 | € | 16.900 | 17.049 |
| Sveriges Sakerstallda Obligationer AB 1,000 % fällig am 17.03.2021 | SEK | 156.000 | 15.511 |
| Nordea Hypotek AB 1,250 % fällig am 19.05.2021 | | 115.000 | 11.505 |
| Stadshypotek AB 1,500 % fällig am 17.03.2021 | | 113.000 | 11.353 |
| Europäische Union 3,500 % fällig am 04.06.2021 | € | 8.800 | 9.529 |
| Dexia Credit Local S.A. 2,000 % fällig am 22.01.2021 | | 8.700 | 9.064 |
| Europäischer Stabilitätsmechanismus 0,100 % fällig am 03.11.2020 | | 7.900 | 7.972 |
| Bundesrepublik Deutschland 0,000 % fällig am 08.10.2021 | | 6.400 | 6.488 |
| FMS Wertmanagement 0,000 % fällig am 13.11.2020 | | 5.700 | 5.740 |
| Cooperatieve Rabobank UA 6,875 % fällig am 19.03.2020 | | 5.000 | 5.301 |
| Volkswagen Bank GmbH 0,102 % fällig am 15.06.2021 | | 5.200 | 5.183 |
| Hungary Government International Bond 3,500 % fällig am 24.06.2020 | HUF | 1.428.000 | 4.688 |
| FMS Wertmanagement 3,000 % fällig am 08.09.2021 | € | 4.000 | 4.335 |
| Wells Fargo & Co. 0,308 % fällig am 26.04.2021 | | 3.600 | 3.624 |
| Erste Abwicklungsanstalt 0,000 % fällig am 12.06.2020 | | 3.000 | 3.014 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 2,850 % fällig am 25.10.2019 | CHF | 3.250 | 2.923 |
| UBS AG 0,189 % fällig am 23.04.2021 | € | 2.900 | 2.915 |
| IPIC GMTN Ltd. 5,875 % fällig am 14.03.2021 | | 2.300 | 2.567 |
| Bumper NL Finance BV 0,004 % fällig am 22.07.2031 | | 2.350 | 2.354 |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 3,375 % fällig am 25.04.2021 | | 2.000 | 2.159 |
| Cartesian Residential Mortgages S.A. 0,792 % fällig am 18.07.2044 | | 2.085 | 2.088 |
| Deutsche Bank AG 0,180 % fällig am 07.12.2020 | | 2.100 | 2.054 |

(a) Der Euro Low Duration 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Euro Short-Term Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| **Provence Alpes Cote d'Azur** | | | |
| 0,010 % fällig am 25.04.2019 | € | 15.000 | € 15.005 |
| **Provence Alpes Cote d'Azur** | | | |
| 0,010 % fällig am 20.05.2019 | | 15.000 | 15.004 |
| **Lloyds Bank PLC** | | | |
| 0,500 % fällig am 22.07.2020 | | 11.300 | 11.395 |
| **Schaeffler Finance BV** | | | |
| 3,250 % fällig am 15.05.2025 | | 9.600 | 9.950 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** | | | |
| 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 6.700 | 7.850 |
| **First Abu Dhabi Bank PJSC** | | | |
| 3,551 % fällig am 16.04.2022 | $ | 8.200 | 7.328 |
| **Santander UK PLC** | | | |
| 4,250 % fällig am 12.04.2021 | € | 6.700 | 7.325 |
| **Banca Carige SpA** | | | |
| 1,389 % fällig am 25.10.2021 | | 7.000 | 7.067 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | |
| 2,890 % fällig am 19.02.2021 | $ | 7.500 | 6.637 |
| **Deposit Insurance Corp. of Japan** | | | |
| 0,100 % fällig am 17.01.2020 | ¥ | 800.000 | 6.540 |
| **Medtronic Global Holdings S.C.A.** | | | |
| 0,000 % fällig am 07.03.2021 | € | 5.300 | 5.312 |
| **General Motors Financial Co., Inc.** | | | |
| 0,207 % fällig am 26.03.2022 | | 5.300 | 5.179 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | |
| 1,000 % fällig am 25.02.2022 | | 4.800 | 4.814 |
| **Rosneft Finance S.A.** | | | |
| 7,250 % fällig am 02.02.2020 | $ | 5.000 | 4.552 |
| **Jyske Realkredit A/S** | | | |
| 1,000 % fällig am 01.10.2019 | DKK | 33.000 | 4.455 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | |
| 2,750 % fällig am 26.03.2020 | $ | 4.600 | 4.075 |
| **Deutsche Bank AG** | | | |
| 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 3.900 | 3.898 |
| **ING Bank NV** | | | |
| 3,625 % fällig am 25.02.2026 | | 3.600 | 3.803 |
| **ABB Finance BV** | | | |
| 0,040 % fällig am 12.10.2020 | | 3.400 | 3.409 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | |
| 1,159 % fällig am 01.08.2022 | | 3.300 | 3.335 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** | | | |
| 3,352 % fällig am 15.11.2019 | | 2.900 | 2.955 |
| **CNP Assurances** | | | |
| 6,000 % fällig am 14.09.2040 | | 2.700 | 2.904 |
| **Bank of America Corp.** | | | |
| 1,375 % fällig am 10.09.2021 | | 2.700 | 2.789 |
| **AP Moller - Maersk A/S** | | | |
| 1,750 % fällig am 18.03.2021 | | 2.700 | 2.784 |
| **BMW Finance NV** | | | |
| 0,125 % fällig am 13.07.2022 | | 2.500 | 2.495 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | |
| 1,000 % fällig am 01.04.2020 | DKK | 18.200 | 2.475 |
| **National Westminster Bank PLC** | | | |
| 3,875 % fällig am 19.10.2020 | € | 2.200 | 2.349 |
| **Braskem Finance Ltd.** | | | |
| 6,450 % fällig am 03.02.2024 | $ | 2.388 | 2.303 |
| **NORD/LB Luxembourg S.A. Covered Bond Bank** | | | |
| 0,250 % fällig am 10.03.2020 | € | 2.200 | 2.209 |
| **Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.** | | | |
| 1,250 % fällig am 14.04.2022 | | 2.000 | 2.058 |
| **ING Bank NV** | | | |
| 0,090 % fällig am 08.04.2022 | | 1.900 | 1.908 |
| **Serbia Government International Bond** | | | |
| 4,875 % fällig am 25.02.2020 | $ | 2.100 | 1.869 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| **Stadshypotek AB** | | | |
| 4,250 % fällig am 17.06.2020 | SEK | 258.000 | € 26.684 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | |
| 0,040 % fällig am 11.12.2019 | € | 25.600 | 25.667 |
| **Nordea Hypotek AB** | | | |
| 3,250 % fällig am 17.06.2020 | SEK | 219.300 | 22.381 |
| **FMS Wertmanagement** | | | |
| 1,375 % fällig am 15.01.2020 | € | 20.000 | 20.287 |
| **FMS Wertmanagement** | | | |
| 0,000 % fällig am 20.10.2020 | | 12.900 | 12.982 |
| **JPMorgan Chase Bank N.A.** | | | |
| 2,890 % fällig am 19.02.2021 | $ | 7.500 | 6.655 |
| **Swedbank Hypotek AB** | | | |
| 5,700 % fällig am 12.05.2020 | SEK | 57.700 | 6.052 |
| **Hungary Government International Bond** | | | |
| 3,500 % fällig am 24.06.2020 | HUF | 1.664.400 | 5.464 |
| **LeasePlan Corp. NV** | | | |
| 1,000 % fällig am 25.02.2022 | € | 4.800 | 4.894 |
| **Volkswagen Bank GmbH** | | | |
| 1,159 % fällig am 01.08.2022 | | 3.300 | 3.359 |
| **Dexia Credit Local S.A.** | | | |
| 0,250 % fällig am 19.03.2020 | | 3.200 | 3.217 |
| **Sinopec Group Overseas Development Ltd.** | | | |
| 1,750 % fällig am 29.09.2019 | $ | 3.400 | 2.990 |
| **ING Bank NV** | | | |
| 0,090 % fällig am 26.11.2020 | € | 1.900 | 1.907 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | |
| 0,489 % fällig am 15.02.2021 | | 900 | 905 |
| **Volkswagen Financial Services AG** | | | |
| 0,040 % fällig am 11.10.2019 | | 900 | 901 |
| **Export-Import Bank of China** | | | |
| 0,300 % fällig am 06.03.2022 | | 200 | 201 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | |
| 3,236 % fällig am 26.07.2021 | $ | 200 | 178 |
| **Comcast Corp.** | | | |
| 2,649 % fällig am 01.10.2020 | | 200 | 175 |
| **Bundesrepublik Deutschland** | | | |
| 0,000 % fällig am 13.12.2019 | € | 150 | 151 |
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 3,547 % fällig am 15.07.2021 | $ | 100 | 89 |

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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Advantage Fund

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 13.528.040 | $ 135.447 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Russia Government International Bond 7,950 % fällig am 07.10.2026 | RUB | 1.139.700 | 17.462 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,350 % fällig am 01.03.2035 | € | 7.900 | 8.996 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 55.600 | 8.303 |
| Province of Ontario 2,400 % fällig am 02.06.2026 | CAD | 11.000 | 8.126 |
| Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029 | € | 6.100 | 6.908 |
| Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 | ¥ | 726.016 | 6.827 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,000 % fällig am 01.08.2029 | € | 5.000 | 6.059 |
| Japan Government International Bond 0,700 % fällig am 20.12.2048 | ¥ | 636.000 | 5.901 |
| Japan Government International Bond 0,500 % fällig am 20.03.2049 | | 578.000 | 5.223 |
| Peru Government International Bond 6,350 % fällig am 12.08.2028 | PEN | 14.800 | 4.709 |
| Japan Government Forty Year Bond 0,800 % fällig am 20.03.2058 | ¥ | 440.000 | 4.244 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,100 % fällig am 15.07.2026 | € | 3.500 | 4.030 |
| Spain Government International Bond 0,250 % fällig am 30.07.2024 | | 3.000 | 3.432 |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 2,500 % fällig am 31.05.2022 | $ | 3.400 | 3.395 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 2.400 | 3.173 |
| Indonesia Government International Bond 8,375 % fällig am 15.03.2034 | IDR | 45.254.000 | 3.148 |
| Kraft Heinz Foods Co. 4,875 % fällig am 15.02.2025 | $ | 2.900 | 2.991 |
| Jyske Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 20.000 | 2.988 |
| China Development Bank 3,680 % fällig am 26.02.2026 | CNY | 20.700 | 2.971 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 11.885.067 | $ 119.001 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Province of Ontario 2,400 % fällig am 02.06.2026 | CAD | 22.000 | 16.254 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,350 % fällig am 01.03.2035 | € | 7.900 | 9.215 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | $ | 5.809 | 5.778 |
| Swedbank Hypotek AB 1,000 % fällig am 15.06.2022 | SEK | 42.100 | 4.682 |
| Japan Government Forty Year Bond 0,800 % fällig am 20.03.2058 | ¥ | 440.000 | 4.315 |
| Indonesia Government International Bond 9,000 % fällig am 15.03.2029 | IDR | 54.197.000 | 4.014 |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 2,250 % fällig am 04.05.2020 | $ | 3.400 | 3.394 |
| Nigeria Treasury Bills 0,000 % fällig am 04.04.2019 | NGN | 1.205.000 | 3.207 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,750 % fällig am 15.01.2029 | € | 2.500 | 2.942 |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,400 % fällig am 26.01.2026 | | 2.400 | 2.754 |
| Bank of Nova Scotia 1,875 % fällig am 26.04.2021 | $ | 2.600 | 2.589 |
| UBS AG 3,031 % fällig am 08.06.2020 | | 2.400 | 2.410 |
| Province of Alberta 2,350 % fällig am 01.06.2025 | CAD | 3.200 | 2.404 |
| Morgan Stanley 3,737 % fällig am 24.04.2024 | $ | 2.300 | 2.321 |
| Dexia Credit Local S.A. 2,000 % fällig am 22.01.2021 | € | 1.900 | 2.209 |
| Japan Finance Organization for Municipalities 2,125 % fällig am 13.04.2021 | $ | 2.000 | 1.998 |
| Royal Bank of Canada 2,300 % fällig am 22.03.2021 | | 1.900 | 1.906 |
| Orange S.A. 1,125 % fällig am 15.07.2024 | € | 1.600 | 1.848 |
| Digital Euro Finco LLC 2,500 % fällig am 16.01.2026 | | 1.600 | 1.836 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Advantage Real Return Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 2.497.416 | $ 25.006 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 3.206 | 3.279 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 2.655 | 2.938 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 2.555 | 2.457 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | | 2.457 | 2.362 |
| Spain Government International Bond 0,150 % fällig am 30.11.2023 | € | 1.840 | 2.177 |
| France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027 | | 1.551 | 2.166 |
| France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024 | | 1.729 | 2.115 |
| Spain Government International Bond 0,650 % fällig am 30.11.2027 | | 1.647 | 2.008 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | $ | 1.753 | 1.742 |
| Jyske Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 8.100 | 1.199 |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026 | £ | 681 | 1.055 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b) | $ | 1.058 | 1.034 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 3,625 % fällig am 15.04.2028 (b) | | 784 | 991 |
| France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2036 | € | 750 | 942 |
| France Government International Bond 2,100 % fällig am 25.07.2023 | | 680 | 880 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.02.2040 (b) | $ | 704 | 874 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | | 853 | 868 |
| France Government International Bond 1,800 % fällig am 25.07.2040 | € | 359 | 592 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b) | $ | 583 | 578 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 2.426.973 | $ 24.300 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b) | $ | 5.225 | 5.175 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 3.541 | 3.918 |
| France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027 | € | 2.603 | 3.657 |
| France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024 | | 2.704 | 3.272 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 3.060 | 3.141 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 2.561 | 2.531 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 1.762 | 2.052 |
| United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 07.09.2037 | £ | 1.470 | 1.944 |
| Spain Government International Bond 1,800 % fällig am 30.11.2024 | € | 1.449 | 1.885 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b) | $ | 1.792 | 1.771 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.02.2040 (b) | | 1.408 | 1.748 |
| Bonos del Banco Central de Chile en UF 3,000 % fällig am 01.03.2022 | CLP | 1.107.591 | 1.729 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | $ | 1.643 | 1.639 |
| Mexico Government International Bond 4,000 % fällig am 15.11.2040 | MXN | 31.336 | 1.617 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % fällig am 15.05.2028 | € | 1.129 | 1.236 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,550 % fällig am 15.09.2041 | | 938 | 1.109 |
| Colombian TES 3,000 % fällig am 25.03.2033 | COP | 3.837.492 | 1.078 |
| Israel Government International Bond 4,000 % fällig am 30.05.2036 | ILS | 2.100 | 1.061 |
| Turkey Government International Bond 2,900 % fällig am 07.07.2027 | TRY | 5.092 | 872 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | $ | 848 | 841 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 787 | 800 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 3,875 % fällig am 15.04.2029 (b) | | 581 | 778 |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2046 | £ | 354 | 761 |

(a) Der Global Advantage 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond ESG Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| Japan Government International Bond 0,700 % fällig am 20.12.2048 | ¥ | 1.022.000 | $ 9.581 |
| QNB Finance Ltd. 3,576 % fällig am 02.05.2022 | $ | 8.200 | 8.200 |
| Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.03.2029 | ¥ | 630.000 | 5.859 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund (a) | | 580.000 | 5.800 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029 | € | 5.100 | 5.777 |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 2,375 % fällig am 31.05.2022 | $ | 5.700 | 5.682 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,350 % fällig am 01.03.2035 | € | 4.900 | 5.580 |
| Japan Government International Bond 0,500 % fällig am 20.03.2049 | ¥ | 608.000 | 5.546 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 34.900 | 5.214 |
| Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.06.2049 | $ | 5.000 | 5.045 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,000 % fällig am 01.08.2029 | € | 3.600 | 4.363 |
| Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 | ¥ | 453.735 | 4.252 |
| Japan Government Forty Year Bond 0,800 % fällig am 20.03.2058 | | 412.000 | 3.962 |
| BNP Paribas S.A. 4,705 % fällig am 10.01.2025 | $ | 3.300 | 3.529 |
| Vodafone Group PLC 0,900 % fällig am 24.11.2026 | € | 3.000 | 3.339 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,100 % fällig am 15.07.2026 | | 2.800 | 3.224 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 02.04.2024 | | 2.700 | 3.080 |
| Jyske Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 20.600 | 3.070 |
| Japan Treasury Bills 0,000 % fällig am 29.07.2019 | ¥ | 330.000 | 2.949 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 2.376 | 2.836 |
| China Development Bank 4,880 % fällig am 09.02.2028 | CNY | 17.800 | 2.815 |
| Ryder System, Inc. 2,875 % fällig am 01.06.2022 | $ | 2.800 | 2.803 |
| Spain Government International Bond 0,250 % fällig am 30.07.2024 | € | 2.400 | 2.745 |
| China Development Bank 3,680 % fällig am 26.02.2026 | CNY | 18.600 | 2.670 |
| Citigroup, Inc. 0,500 % fällig am 29.01.2022 | € | 2.300 | 2.610 |
| Deutsche Pfandbriefbank AG 2,500 % fällig am 31.05.2022 | $ | 2.600 | 2.596 |
| China Development Bank 4,240 % fällig am 24.08.2027 | CNY | 17.300 | 2.570 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 1.900 | 2.512 |
| Verizon Communications, Inc. 3,875 % fällig am 08.02.2029 | $ | 2.500 | 2.495 |
| American Water Capital Corp. 3,450 % fällig am 01.06.2029 | | 2.500 | 2.494 |
| Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 2.300 | 2.384 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| Province of Ontario 2,650 % fällig am 05.02.2025 | CAD | 8.000 | $ 6.166 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,350 % fällig am 01.03.2035 | € | 4.900 | 5.712 |
| Fannie Mae Pool 3,500 % fällig am 01.06.2049 | $ | 5.000 | 5.077 |
| Japan Government Forty Year Bond 0,800 % fällig am 20.03.2058 | ¥ | 412.000 | 4.041 |
| BPCE S.A. 0,625 % fällig am 26.09.2023 | € | 2.700 | 3.073 |
| United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.01.2045 | £ | 1.600 | 2.836 |
| United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2046 | | 1.400 | 2.823 |
| Swedbank Hypotek AB 1,000 % fällig am 15.06.2022 | SEK | 25.300 | 2.812 |
| Santander UK Group Holdings PLC 3,823 % fällig am 03.11.2028 | $ | 2.800 | 2.616 |
| ING Groep NV 2,500 % fällig am 15.11.2030 | € | 1.900 | 2.294 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 4,800 % fällig am 05.04.2026 | $ | 2.200 | 2.204 |
| Citigroup, Inc. 3,887 % fällig am 10.01.2028 | | 2.200 | 2.200 |
| Credit Agricole S.A. 0,750 % fällig am 05.12.2023 | € | 1.900 | 2.180 |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,400 % fällig am 26.01.2026 | | 1.600 | 1.834 |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,200 % fällig am 17.01.2024 | | 1.500 | 1.721 |
| Citigroup, Inc. 1,500 % fällig am 24.07.2026 | | 1.100 | 1.275 |
| Verizon Communications, Inc. 3,410 % fällig am 16.03.2022 | $ | 1.200 | 1.212 |
| Discover Financial Services 4,100 % fällig am 09.02.2027 | | 1.200 | 1.181 |
| JPMorgan Chase & Co. 3,300 % fällig am 01.04.2026 | | 1.000 | 997 |
| GE Capital International Funding Co. Unlimited Co. 3,373 % fällig am 15.11.2025 | | 1.000 | 947 |
| JPMorgan Chase & Co. 3,782 % fällig am 01.02.2028 | | 800 | 805 |
| Province of Quebec 2,500 % fällig am 01.09.2026 | CAD | 1.000 | 759 |
| Aroundtown S.A. 3,000 % fällig am 16.10.2029 | £ | 600 | 755 |
| Verizon Communications, Inc. 3,875 % fällig am 08.02.2029 | $ | 700 | 713 |

(a) Der Global Bond ESG 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Bond Ex-US Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 14.470.590 | 144.900 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 20.03.2029 | ¥ | 3.740.000 | 34.554 |
| Japan Government International Bond 0,700 % fällig am 20.12.2048 | | 1.838.000 | 17.089 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,350 % fällig am 01.03.2035 | € | 8.000 | 9.110 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 | | 59.000 | 8.766 |
| Japan Government International Bond 0,500 % fällig am 20.03.2049 | ¥ | 966.000 | 8.728 |
| Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029 | € | 7.400 | 8.379 |
| Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 | ¥ | 776.391 | 7.276 |
| Japan Government Forty Year Bond 0,800 % fällig am 20.03.2058 | | 742.000 | 7.142 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,000 % fällig am 01.08.2029 | € | 5.800 | 7.029 |
| Land Nordrhein-Westfalen 0,250 % fällig am 13.03.2026 | | 5.600 | 6.331 |
| China Development Bank 4,880 % fällig am 09.02.2028 | CNY | 34.500 | 5.464 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,100 % fällig am 15.07.2026 | € | 4.400 | 5.066 |
| China Development Bank 3,680 % fällig am 26.02.2026 | CNY | 33.700 | 4.837 |
| Qatar Government International Bond 3,375 % fällig am 14.03.2024 | $ | 4.800 | 4.820 |
| Russia Government International Bond 7,950 % fällig am 07.10.2026 | RUB | 280.700 | 4.410 |
| Spain Government International Bond 0,250 % fällig am 30.07.2024 | € | 3.800 | 4.347 |
| China Development Bank 4,240 % fällig am 24.08.2027 | CNY | 29.200 | 4.338 |
| Europäische Investitionsbank 0,050 % fällig am 24.05.2024 | € | 3.800 | 4.332 |
| Spain Government International Bond 1,400 % fällig am 30.07.2028 | | 3.300 | 3.986 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 14.062.016 | 140.801 |
| | | **PARI (000S)** | |
| United Kingdom Gilt 3,250 % fällig am 22.01.2044 | £ | 10.000 | 16.929 |
| Province of Ontario 3,500 % fällig am 02.06.2024 | CAD | 13.800 | 11.049 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,350 % fällig am 01.03.2035 | € | 8.000 | 9.323 |
| Japan Government Forty Year Bond 0,800 % fällig am 20.03.2058 | ¥ | 742.000 | 7.277 |
| Nordea Hypotek AB 1,000 % fällig am 08.04.2022 | SEK | 55.100 | 6.123 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 53.200 | 5.945 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Stadshypotek AB 4,500 % fällig am 21.09.2022 | SEK | 46.000 | 5.691 |
| Skandinaviska Enskilda Banken AB 1,500 % fällig am 15.12.2021 | | 49.000 | 5.493 |
| Saudi Government International Bond 4,500 % fällig am 17.04.2030 | $ | 5.000 | 5.174 |
| Lansforsakringar Hypotek AB 1,250 % fällig am 20.09.2023 | SEK | 40.000 | 4.523 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | $ | 4.507 | 4.333 |
| Swedbank Hypotek AB 1,000 % fällig am 15.06.2022 | SEK | 37.600 | 4.179 |
| United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.01.2045 | £ | 2.300 | 4.059 |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,200 % fällig am 17.01.2024 | € | 3.500 | 4.016 |
| Europäische Finanzstabilisierungsfazilität 0,400 % fällig am 26.01.2026 | | 3.200 | 3.671 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % fällig am 02.04.2024 | | 3.000 | 3.414 |
| Wells Fargo & Co. 3,813 % fällig am 31.10.2023 | $ | 3.100 | 3.146 |
| Province of Ontario 2,600 % fällig am 02.06.2025 | CAD | 4.000 | 3.066 |
| Charter Communications Operating LLC 6,384 % fällig am 23.10.2035 | $ | 2.800 | 3.020 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global High Yield Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 8.765.494 | $ 87.763 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Staples, Inc. 7,500 % fällig am 15.04.2026 | $ | 10.000 | 9.985 |
| Dun & Bradstreet Corp. 6,875 % fällig am 15.08.2026 | | 8.000 | 8.087 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a) | | 771.456 | 8.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 2,200 % fällig am 21.07.2021 | $ | 8.000 | 7.598 |
| EnLink Midstream LLC 5,375 % fällig am 01.06.2029 | | 7.500 | 7.500 |
| Clear Channel Worldwide Holdings Inc. 9,250 % fällig am 15.02.2024 | | 6.500 | 6.500 |
| TransDigm Inc. 6,250 % fällig am 15.03.2026 | | 5.500 | 5.703 |
| Starfruit Finco BV 6,500 % fällig am 01.10.2026 | € | 5.000 | 5.651 |
| INEOS Finance PLC 2,875 % fällig am 01.05.2026 | | 5.000 | 5.631 |
| Tasty Bondco 1 S.A. 6,250 % fällig am 15.05.2026 | | 5.000 | 5.588 |
| Darling Ingredients, Inc. 5,250 % fällig am 15.04.2027 | $ | 5.550 | 5.550 |
| Bausch Health Cos., Inc. 5,750 % fällig am 15.08.2027 | | 5.000 | 5.130 |
| Refinitiv U.S. Holdings, Inc. 6,875 % fällig am 15.11.2026 | € | 4.500 | 5.094 |
| LABL Escrow Issuer LLC 6,750 % fällig am 15.07.2026 | $ | 5.000 | 5.021 |
| Albertsons Cos. LLC 7,500 % fällig am 15.03.2026 | | 5.000 | 5.008 |
| Stericycle, Inc. 5,375 % fällig am 15.07.2024 | | 5.000 | 5.000 |
| Prime Security Services Borrower LLC 5,250 % fällig am 15.04.2024 | | 5.000 | 5.000 |
| Tenet Healthcare Corp. 6,250 % fällig am 01.02.2027 | | 5.000 | 5.000 |
| Vistra Operations Co. LLC 5,625 % fällig am 15.02.2027 | | 5.000 | 5.000 |
| Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC 6,500 % fällig am 01.10.2025 | | 5.000 | 4.956 |
| Frontier Communications Corp. 8,500 % fällig am 01.04.2026 | | 5.000 | 4.751 |
| Lincoln Financing SARL 3,625 % fällig am 01.04.2024 | € | 4.000 | 4.508 |
| Bombardier, Inc. 7,875 % fällig am 15.04.2027 | $ | 4.500 | 4.466 |
| Colfax Corp. 3,250 % fällig am 15.05.2025 | € | 4.000 | 4.408 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 1.758.238 | $ 17.600 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Teck Resources Ltd. 6,125 % fällig am 01.10.2035 | $ | 10.000 | 10.657 |
| Societe Generale S.A. 7,875 % fällig am 27.04.2025 | | 10.000 | 10.393 |
| First Data Corp. 5,750 % fällig am 15.01.2024 | | 7.000 | 7.225 |
| Tesco Property Finance PLC 6,052 % fällig am 13.10.2039 | £ | 4.423 | 6.814 |
| USG Corp. 5,500 % fällig am 01.03.2025 | $ | 6.250 | 6.313 |
| Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.03.2023 | | 6.000 | 6.055 |
| Newfield Exploration Co. 5,625 % fällig am 01.07.2024 | | 5.000 | 5.350 |
| HCA, Inc. 5,875 % fällig am 15.03.2022 | | 5.000 | 5.281 |
| HCA, Inc. 5,250 % fällig am 15.04.2025 | | 5.000 | 5.256 |
| HCA, Inc. 5,000 % fällig am 15.03.2024 | | 5.000 | 5.207 |
| HCA, Inc. 5,250 % fällig am 15.06.2026 | | 5.000 | 5.200 |
| HCA, Inc. 4,750 % fällig am 01.05.2023 | | 5.000 | 5.125 |
| Equinix, Inc. 2,875 % fällig am 01.10.2025 | € | 4.000 | 4.613 |
| PetSmart, Inc. 7,125 % fällig am 15.03.2023 | $ | 5.000 | 4.373 |
| Newfield Exploration Co. 5,375 % fällig am 01.01.2026 | | 4.000 | 4.230 |
| Newfield Exploration Co. 5,750 % fällig am 30.01.2022 | | 4.000 | 4.204 |
| Hudbay Minerals, Inc. 7,250 % fällig am 15.01.2023 | | 4.000 | 4.143 |
| HCA, Inc. 5,500 % fällig am 15.06.2047 | | 4.000 | 4.125 |
| Tele Columbus AG 3,875 % fällig am 02.05.2025 | € | 3.700 | 3.949 |
| Park Aerospace Holdings Ltd. 5,500 % fällig am 15.02.2024 | $ | 3.500 | 3.669 |
| Sisal Group SpA 7,000 % fällig am 31.07.2023 | € | 3.000 | 3.504 |
| Frontier Communications Corp. 10,500 % fällig am 15.09.2022 | $ | 5.000 | 3.439 |
| Altice Luxembourg S.A. 7,250 % fällig am 15.05.2022 | € | 3.000 | 3.404 |
| Altice Luxembourg S.A. 6,250 % fällig am 15.02.2025 | | 3.000 | 3.295 |
| Blackstone CQP Holdco LP 6,500 % fällig am 20.03.2021 | $ | 3.250 | 3.248 |
| Mallinckrodt International Finance S.A. 5,750 % fällig am 01.08.2022 | | 3.500 | 3.184 |
| AmeriGas Partners LP 5,500 % fällig am 20.05.2025 | | 3.000 | 3.150 |
| Samsonite Finco Sarl 3,500 % fällig am 15.05.2026 | € | 2.650 | 3.016 |
| Ardagh Packaging Finance PLC 6,750 % fällig am 15.05.2024 | | 2.500 | 3.005 |
| Teck Resources Ltd. 6,000 % fällig am 15.08.2040 | $ | 3.000 | 2.990 |
| Intesa Sanpaolo SpA 7,700 % fällig am 17.09.2025 | | 3.000 | 2.851 |
| Frontier Communications Corp. 6,875 % fällig am 15.01.2025 | | 5.000 | 2.770 |
| Wind Tre SpA 3,125 % fällig am 20.01.2025 | € | 2.500 | 2.736 |
| Service Corp International 5,125 % fällig am 01.06.2029 | $ | 2.500 | 2.533 |
| Silgan Holdings, Inc. 4,750 % fällig am 15.03.2025 | | 2.500 | 2.519 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Investment Grade Credit Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 296.557.005 | $ 2.969.376 |
| | | PARI (000S) | |
| U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049 | $ | 782.974 | 813.190 |
| U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049 | | 401.795 | 426.204 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 422.466 | 422.320 |
| U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.05.2024 | | 293.480 | 295.866 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2029 | | 251.215 | 249.496 |
| U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.11.2048 | | 182.375 | 197.672 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | | 142.812 | 140.694 |
| U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.11.2028 | | 106.654 | 110.692 |
| UBS Group Funding Switzerland AG 4,125 % fällig am 24.09.2025 | | 93.650 | 97.736 |
| U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.10.2024 | | 93.100 | 91.267 |
| Fannie Mae UMBS 3,500 % fällig am 01.06.2049 | | 74.993 | 75.657 |
| Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 59.000 | 58.537 |
| UniCredit SpA 7,500 % fällig am 03.06.2026 | € | 43.000 | 48.480 |
| Credit Suisse Group AG 4,207 % fällig am 12.06.2024 | $ | 44.475 | 45.696 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 41.200 | 41.418 |
| China Evergrande Group 7,000 % fällig am 23.03.2020 | | 41.100 | 40.593 |
| Dell International LLC 4,000 % fällig am 15.07.2024 | | 39.100 | 38.928 |
| Anheuser-Busch Cos. LLC 4,900 % fällig am 01.02.2046 | | 37.600 | 38.351 |
| HSBC Holdings PLC 3,681 % fällig am 11.03.2025 | | 37.550 | 37.653 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 296.275.325 | $ 2.966.397 |
| | | PARI (000S) | |
| U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.11.2028 | $ | 345.350 | 359.412 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 297.180 | 301.093 |
| U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.04.2022 | | 283.220 | 277.155 |
| U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.10.2024 | | 186.200 | 182.721 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | | 142.055 | 143.031 |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 30.06.2022 | | 135.000 | 133.069 |
| U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.07.2022 | | 110.787 | 108.331 |
| U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.11.2048 | | 91.656 | 98.901 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | | 93.418 | 91.229 |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 84.805 | 83.323 |
| BellSouth LLC 4,266 % fällig am 26.04.2020 | | 79.350 | 79.350 |
| Fannie Mae UMBS 3,500 % fällig am 01.06.2049 | | 74.993 | 76.191 |
| Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 3,975 % fällig am 09.11.2027 | | 64.500 | 61.506 |
| Wynn Las Vegas LLC 5,500 % fällig am 01.03.2025 | | 38.993 | 38.426 |
| KBC Group NV 4,250 % fällig am 24.10.2025 | € | 36.000 | 38.207 |
| Reckitt Benckiser Treasury Services PLC 2,750 % fällig am 26.06.2024 | $ | 38.000 | 36.968 |
| Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 2,750 % fällig am 26.03.2020 | | 36.400 | 36.337 |
| Poly Real Estate Finance Ltd. 4,750 % fällig am 17.09.2023 | | 33.900 | 34.544 |
| Poly Real Estate Finance Ltd. 3,950 % fällig am 05.02.2023 | | 34.400 | 34.162 |

(a) Der Global Investment Grade Credit Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Investment Grade Credit ESG Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,000 % fällig am 15.08.2048 | $ | 6.480 | $ | 6.453 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,375 % fällig am 15.11.2048 | | 5.446 | | 5.840 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,750 % fällig am 15.07.2028 (a) | | 4.010 | | 4.007 |
| **U.S. Treasury Note** 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 1.680 | | 1.695 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 1.110 | | 1.145 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,875 % fällig am 15.01.2029 (a) | | 1.004 | | 1.042 |
| **HSBC Holdings PLC** 3,973 % fällig am 22.05.2030 | | 1.000 | | 1.000 |
| **Canada Housing Trust** 2,650 % fällig am 15.12.2028 | CAD | 1.000 | | 773 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 15.05.2029 | $ | 683 | | 676 |
| **Ryder System, Inc.** 2,875 % fällig am 01.06.2022 | | 600 | | 600 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** 2,957 % fällig am 08.11.2022 | | 600 | | 598 |
| **SNCF Reseau** 0,750 % fällig am 25.05.2036 | € | 500 | | 558 |
| **U.S. Treasury Note** 3,125 % fällig am 15.11.2028 | $ | 500 | | 516 |
| **Deutsche Bank AG** 3,875 % fällig am 12.02.2024 | £ | 400 | | 514 |
| **Tencent Holdings Ltd.** 3,975 % fällig am 11.04.2029 | $ | 500 | | 502 |
| **Bank of America N.A.** 3,335 % fällig am 25.01.2023 | | 500 | | 500 |
| **JPMorgan Chase & Co.** 3,960 % fällig am 29.01.2027 | | 500 | | 500 |
| **Citigroup, Inc.** 0,500 % fällig am 29.01.2022 | € | 400 | | 454 |
| **Enel Finance International NV** 4,625 % fällig am 14.09.2025 | $ | 400 | | 415 |
| **CRH America, Inc.** 3,875 % fällig am 18.05.2025 | | 400 | | 407 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | | |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,000 % fällig am 15.08.2048 | $ | 7.880 | $ | 7.846 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,375 % fällig am 15.11.2048 | | 5.446 | | 5.856 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,750 % fällig am 15.07.2028 (a) | | 4.412 | | 4.408 |
| **U.S. Treasury Note** 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 1.680 | | 1.696 |
| **Province of Ontario** 2,900 % fällig am 02.06.2028 | CAD | 1.300 | | 1.007 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,000 % fällig am 15.02.2049 | $ | 870 | | 945 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.07.2024 (a) | | 529 | | 519 |
| **U.S. Treasury Note** 3,125 % fällig am 15.11.2028 | | 500 | | 516 |
| **Deutsche Bank AG** 3,875 % fällig am 12.02.2024 | £ | 400 | | 514 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 15.05.2029 | $ | 500 | | 500 |
| **Vodafone Group PLC** 4,375 % fällig am 30.05.2028 | | 390 | | 397 |
| **UniCredit SpA** 7,830 % fällig am 04.12.2023 | | 350 | | 369 |
| **Kinder Morgan Energy Partners LP** 4,300 % fällig am 01.05.2024 | | 347 | | 353 |
| **Verizon Communications, Inc.** 0,500 % fällig am 02.06.2022 | € | 300 | | 343 |
| **Mexico Government International Bond** 1,375 % fällig am 15.01.2025 | | 300 | | 338 |
| **BMW U.S. Capital LLC** 3,950 % fällig am 14.08.2028 | $ | 321 | | 327 |
| **Svenska Handelsbanken AB** 3,900 % fällig am 20.11.2023 | | 300 | | 312 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** 3,250 % fällig am 01.11.2025 | | 300 | | 310 |
| **CVS Health Corp.** 4,100 % fällig am 25.03.2025 | | 300 | | 304 |
| **Qatar Government International Bond** 4,000 % fällig am 14.03.2029 | | 300 | | 300 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Libor Plus Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 9.428.735 | $ 94.418 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Fannie Mae UMBS 3,500 % fällig am 01.05.2049 | $ | 72.858 | 73.664 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 42.736 | 44.112 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 31.01.2023 | | 29.600 | 29.657 |
| Ginnie Mae 3,500 % fällig am 15.07.2045 | | 26.711 | 27.483 |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.05.2026 | | 23.200 | 23.343 |
| Fannie Mae UMBS 3,500 % fällig am 01.07.2048 | | 22.626 | 23.051 |
| U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 30.04.2024 | | 21.700 | 21.669 |
| Fannie Mae UMBS 4,000 % fällig am 01.03.2049 | | 20.778 | 21.414 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 29.02.2024 | | 16.200 | 16.096 |
| U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.05.2024 | | 15.800 | 15.912 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 9.100 | 12.030 |
| Peru Government International Bond 5,940 % fällig am 12.02.2029 | PEN | 26.600 | 8.289 |
| Freddie Mac 3,500 % fällig am 01.03.2049 | $ | 7.380 | 7.460 |
| UBS Group Funding Switzerland AG 4,125 % fällig am 15.04.2026 | | 7.100 | 7.311 |
| U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2021 | | 6.900 | 6.904 |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 1,250 % fällig am 31.03.2023 | € | 5.600 | 5.855 |
| Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 5.700 | 5.655 |
| Fannie Mae UMBS 3,500 % fällig am 01.12.2047 | | 5.388 | 5.489 |
| Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 2,634 % fällig am 25.11.2036 | | 7.283 | 5.244 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2021 (b) | $ | 95.720 | $ 93.718 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 8.831.928 | 88.418 |
| | | **PARI (000S)** | |
| UBS Group Funding Switzerland AG 4,125 % fällig am 15.04.2026 | $ | 7.100 | 7.469 |
| Concho Resources, Inc. 3,750 % fällig am 01.10.2027 | | 5.000 | 4.977 |
| Metropolitan Life Global Funding 0,375 % fällig am 09.04.2024 | € | 4.100 | 4.597 |
| Bristol-Myers Squibb Co. 3,400 % fällig am 26.07.2029 | $ | 4.100 | 4.221 |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 4.200 | 4.217 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 3,021 % fällig am 06.03.2024 | € | 3.200 | 3.803 |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC 2,500 % fällig am 02.05.2025 | £ | 2.900 | 3.738 |
| Marathon Petroleum Corp. 5,125 % fällig am 15.12.2026 | $ | 3.500 | 3.680 |
| Anthem, Inc. 4,101 % fällig am 01.03.2028 | | 3.500 | 3.590 |
| INEOS Finance PLC 2,125 % fällig am 15.11.2025 | € | 3.100 | 3.423 |
| Netflix, Inc. 3,875 % fällig am 15.11.2029 | | 3.000 | 3.363 |
| UniCredit SpA 7,500 % fällig am 19.03.2019 | | 2.800 | 3.240 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 4,223 % fällig am 01.05.2029 | $ | 3.000 | 3.079 |
| Crown Castle International Corp. 3,700 % fällig am 15.06.2026 | | 3.000 | 3.059 |
| Toyota Motor Credit Corp. 2,925 % fällig am 17.05.2022 | | 3.000 | 3.005 |
| Discover Bank 4,650 % fällig am 13.09.2028 | | 2.500 | 2.569 |
| Schaeffler AG 1,125 % fällig am 26.03.2022 | € | 2.200 | 2.521 |
| Verizon Communications, Inc. 3,618 % fällig am 15.05.2025 | $ | 2.500 | 2.517 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Low Duration Real Return Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | $ | 245.249 | $ 243.416 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 21.651.367 | 216.792 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2021 (b) | $ | 169.785 | 168.177 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b) | | 107.460 | 106.228 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 1,250 % fällig am 15.07.2020 (b) | | 89.838 | 90.733 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | | 70.146 | 70.212 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b) | | 64.036 | 63.497 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 61.729 | 61.638 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b) | | 47.680 | 48.120 |
| **France Government International Bond** | | | |
| 2,100 % fällig am 25.07.2023 | € | 31.275 | 40.469 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 2,600 % fällig am 15.09.2023 | | 24.253 | 29.404 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 27.941 | 28.638 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | | 28.314 | 27.144 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 1,875 % fällig am 15.07.2019 (b) | | 22.499 | 22.766 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 1,250 % fällig am 22.11.2027 | £ | 11.672 | 20.452 |
| **Nykredit Realkredit A/S** | | | |
| 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 135.500 | 20.037 |
| **Spain Government International Bond** | | | |
| 1,400 % fällig am 30.07.2028 | € | 15.700 | 19.280 |
| **France Government International Bond** | | | |
| 1,100 % fällig am 25.07.2022 | | 14.399 | 17.606 |
| **France Government International Bond** | | | |
| 2,250 % fällig am 25.07.2020 | | 10.221 | 12.148 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 0,125 % fällig am 10.08.2028 | £ | 7.354 | 11.888 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | | | |
| | $ | 402.239 | $ 398.600 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 23.052.687 | 230.816 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 1,250 % fällig am 15.07.2020 (b) | $ | 180.044 | 181.590 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | | 167.027 | 167.026 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 103.284 | 103.052 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 1,875 % fällig am 15.07.2019 (b) | | 90.020 | 91.078 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | | 54.013 | 54.386 |
| **Italy Buoni Poliennali Del Tesoro** | | | |
| 0,100 % fällig am 15.05.2022 | € | 36.677 | 40.875 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 21.829 | 25.700 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 0,125 % fällig am 10.08.2048 | £ | 7.498 | 16.864 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b) | $ | 16.611 | 16.468 |
| **France Government International Bond** | | | |
| 0,250 % fällig am 25.07.2024 | € | 13.020 | 15.762 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 3,875 % fällig am 15.04.2029 (b) | $ | 11.381 | 15.207 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 13.043 | 13.402 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | | 12.286 | 12.146 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 3,375 % fällig am 15.04.2032 (b) | | 8.876 | 12.028 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 1,125 % fällig am 15.01.2021 (b) | | 10.690 | 10.762 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** | | | |
| 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b) | | 8.682 | 8.826 |
| **France Government International Bond** | | | |
| 1,850 % fällig am 25.07.2027 | € | 6.022 | 8.466 |
| **United Kingdom Gilt** | | | |
| 1,750 % fällig am 07.09.2037 | £ | 5.850 | 7.716 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Multi-Asset Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 18.751.665 | $ 187.759 |
| | | **PARI (000S)** | |
| United Kingdom Gilt 1,875 % fällig am 22.11.2022 | £ | 15.240 | 22.551 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 21.188 | 21.800 |
| United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027 | £ | 10.502 | 18.149 |
| France Government International Bond 2,100 % fällig am 25.07.2023 | € | 13.145 | 17.009 |
| | | **AKTIEN** | |
| Invesco Physical Gold ETC | | 133.374 | 16.995 |
| | | **PARI (000S)** | |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2028 | £ | 10.443 | 16.881 |
| U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026 | $ | 13.300 | 13.288 |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.05.2026 | | 13.100 | 13.084 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 30.04.2026 | | 10.200 | 10.167 |
| U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2026 | | 10.100 | 10.076 |
| U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2026 | | 10.000 | 9.980 |
| U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 9.800 | 9.822 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.01.2026 | | 9.800 | 9.800 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 60.200 | 9.085 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2021 (b) | $ | 8.224 | 8.303 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.07.2021 (b) | | 7.982 | 8.034 |
| U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049 | | 7.400 | 7.622 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b) | | 7.397 | 7.313 |
| Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 45.800 | 6.924 |
| Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 | ¥ | 670.985 | 6.425 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 20.169.173 | $ 201.908 |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 623.032 | 63.073 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.03.2024 | $ | 50.395 | 49.610 |
| U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 15.02.2024 | | 32.400 | 32.780 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 18.263 | 18.833 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 14.872 | 17.376 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b) | | 15.341 | 14.669 |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.05.2026 | | 13.100 | 13.088 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 11.805 | 11.439 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b) | | 11.304 | 11.067 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 30.04.2026 | | 10.200 | 10.190 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2019 (b) | | 10.181 | 10.109 |
| U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2026 | | 10.100 | 10.043 |
| U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2026 | | 10.000 | 9.980 |
| U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 9.800 | 9.809 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.01.2026 | | 9.800 | 9.807 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,750 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 8.143 | 8.789 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | | 8.102 | 7.840 |
| U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049 | | 7.400 | 7.647 |
| United Kingdom Gilt 3,500 % fällig am 22.01.2045 | £ | 3.500 | 6.206 |

(a) Der Global Multi-Asset 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Global Real Return Fund



| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 36.675.976 | $ 367.235 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 77.903 | 79.706 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 3,625 % fällig am 15.04.2028 (b) | | 57.837 | 73.161 |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026 | £ | 35.255 | 53.900 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | $ | 47.988 | 49.207 |
| United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027 | £ | 26.989 | 46.537 |
| Spain Government International Bond 0,650 % fällig am 30.11.2027 | € | 37.375 | 45.559 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.02.2041 (b) | $ | 30.064 | 38.099 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,600 % fällig am 15.09.2023 | € | 29.975 | 36.259 |
| United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2046 | £ | 17.500 | 35.479 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | $ | 30.851 | 30.280 |
| Jyske Realkredit A/S 1,500 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 204.500 | 30.267 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2046 (b) | $ | 28.819 | 29.718 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 25.425 | 25.705 |
| France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027 | € | 17.482 | 24.462 |
| France Government International Bond 1,800 % fällig am 25.07.2040 | | 12.189 | 20.120 |
| France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024 | | 14.649 | 17.865 |
| United Kingdom Gilt 0,625 % fällig am 22.11.2042 | £ | 7.802 | 17.770 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2027 (b) | $ | 17.798 | 17.548 |
| United Kingdom Gilt 1,125 % fällig am 22.11.2037 | £ | 7.612 | 16.564 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b) | $ | 16.305 | 16.228 |
| France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2036 | € | 11.907 | 14.794 |
| United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2032 | £ | 7.562 | 14.698 |
| Spain Government International Bond 0,150 % fällig am 30.11.2023 | € | 11.963 | 14.148 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 34.724.309 | $ 347.700 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | $ | 82.192 | 81.635 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 64.214 | 65.975 |
| France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027 | € | 44.898 | 62.961 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b) | $ | 56.330 | 55.974 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 51.590 | 51.044 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 42.408 | 49.661 |
| France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024 | € | 40.013 | 48.427 |
| France Government International Bond 4,750 % fällig am 25.04.2035 | | 24.500 | 43.184 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % fällig am 15.05.2022 | | 32.382 | 36.088 |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048 | £ | 16.543 | 35.341 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | $ | 29.731 | 29.328 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,250 % fällig am 15.07.2020 (b) | | 27.965 | 28.374 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,125 % fällig am 15.02.2041 (b) | | 21.404 | 27.326 |
| United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.12.2046 | £ | 13.100 | 27.135 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | $ | 25.683 | 26.115 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b) | | 24.572 | 24.348 |
| United Kingdom Gilt 4,250 % fällig am 07.03.2036 | £ | 13.000 | 23.573 |
| France Government International Bond 0,100 % fällig am 25.07.2021 | € | 19.877 | 23.058 |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2046 | £ | 10.554 | 22.830 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,550 % fällig am 15.09.2041 | € | 18.540 | 21.925 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 3,625 % fällig am 15.04.2028 (b) | $ | 11.870 | 15.266 |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.11.2065 | £ | 4.817 | 14.658 |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2068 | | 4.890 | 14.357 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b) | $ | 13.500 | 13.437 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.02.2047 (b) | | 13.621 | 13.321 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Income Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 1.392.345.799 | $ 13.940.980 |
| | | **PARI (000S)** | |
| BNP Paribas Issuance BV 0,000 % fällig am 12.04.2024 | $ | 12 | 2.122.714 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.01.2026 | | 1.177.400 | 1.185.005 |
| Freddie Mac UMBS 3,500 % fällig am 01.04.2049 | | 669.586 | 682.967 |
| Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.01.2049 | | 505.074 | 519.537 |
| Freddie Mac UMBS 4,000 % fällig am 01.01.2049 | | 479.971 | 493.692 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2029 | | 450.600 | 460.852 |
| Argentina Government International Bond 63,705 % fällig am 21.06.2020 | ARS | 17.610.552 | 431.442 |
| Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.12.2048 | $ | 319.532 | 329.239 |
| Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.11.2048 | | 307.239 | 315.851 |
| Freddie Mac 5,000 % fällig am 01.12.2048 | | 269.133 | 283.933 |
| Banca Carige SpA 1,090 % fällig am 25.02.2021 | € | 245.400 | 276.930 |
| Freddie Mac 5,000 % fällig am 01.02.2049 | $ | 260.182 | 274.506 |
| Freddie Mac UMBS 3,500 % fällig am 01.10.2048 | | 266.684 | 271.463 |
| Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.10.2048 | | 218.799 | 224.929 |
| Fannie Mae UMBS 4,000 % fällig am 01.10.2048 | | 202.264 | 206.721 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 199.245 | 205.187 |
| Chester A PLC 0,000 % fällig am 17.03.2046 | £ | 155.692 | 201.972 |
| Freddie Mac UMBS 3,500 % fällig am 01.11.2048 | $ | 193.738 | 196.851 |
| Fannie Mae UMBS 3,500 % fällig am 01.03.2049 | | 191.680 | 193.849 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 1.314.675.815 | $ 13.163.400 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 31.01.2022 | $ | 500.000 | 500.606 |
| Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.01.2049 | | 479.971 | 493.692 |
| U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 28.02.2022 | | 451.700 | 451.445 |
| Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.11.2048 | | 299.083 | 306.473 |
| Fannie Mae UMBS 4,000 % fällig am 01.08.2048 | | 257.138 | 262.361 |
| Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.02.2048 | | 222.162 | 220.227 |
| U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 30.11.2021 | | 220.000 | 219.595 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2027 | | 213.016 | 209.798 |
| Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.05.2049 | | 183.685 | 182.021 |
| Freddie Mac 5,000 % fällig am 01.01.2049 | | 161.802 | 170.944 |
| BellSouth LLC 4,333 % fällig am 26.04.2021 | | 166.520 | 166.520 |
| U.S. Treasury Notes 1,375 % fällig am 30.04.2021 | | 152.000 | 150.602 |
| Freddie Mac 5,000 % fällig am 01.10.2048 | | 140.050 | 147.966 |
| U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.12.2023 | | 142.500 | 141.779 |
| Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.12.2048 | | 137.826 | 141.232 |
| Freddie Mac 3,000 % fällig am 01.03.2048 | | 143.246 | 141.189 |
| Proteus RMBS DAC 0,143 % fällig am 29.10.2054 | € | 119.960 | 136.234 |
| Venture CLO Ltd. 3,507 % fällig am 28.02.2026 | $ | 135.100 | 134.019 |
| Fannie Mae UMBS 4,000 % fällig am 01.09.2048 | | 123.162 | 125.673 |

(a) Der Income 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Inflation Strategy Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 2.418.378 | $ 24.205 |
| | | **PARI (000S)** | |
| United Kingdom Gilt 1,250 % fällig am 22.11.2027 | £ | 2.582 | 4.442 |
| France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027 | € | 2.586 | 3.634 |
| | | **AKTIEN** | |
| Gold Bullion Securities Ltd. | | 28.000 | 3.358 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b) | $ | 3.281 | 3.347 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | | 2.974 | 2.977 |
| France Government International Bond 1,100 % fällig am 25.07.2022 | € | 2.341 | 2.883 |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.03.2026 | £ | 1.389 | 2.118 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 2.000 | 2.060 |
| Spain Government International Bond 0,650 % fällig am 30.11.2027 | € | 1.338 | 1.632 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | $ | 1.449 | 1.478 |
| U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 30.06.2026 | | 1.400 | 1.399 |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.05.2026 | | 1.400 | 1.398 |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2028 | £ | 757 | 1.224 |
| Jyske Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 7.700 | 1.164 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 30.04.2026 | $ | 1.100 | 1.096 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 1.055 | 1.050 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b) | | 1.054 | 1.029 |
| Nykredit Realkredit A/S 1,000 % fällig am 01.10.2050 | DKK | 6.300 | 951 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,125 % fällig am 15.01.2021 (b) | $ | 903 | 912 |
| U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 900 | 902 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.01.2026 | | 900 | 900 |
| U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2026 | | 900 | 898 |
| U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2026 | | 900 | 898 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 1.737.822 | $ 17.400 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b) | $ | 5.533 | 5.677 |
| France Government International Bond 1,850 % fällig am 25.07.2027 | € | 3.611 | 5.075 |
| | | **AKTIEN** | |
| Gold Bullion Securities Ltd. | | 33.992 | 4.080 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b) | $ | 3.695 | 3.666 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,250 % fällig am 15.07.2020 (b) | | 3.342 | 3.384 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.01.2028 (b) | | 3.415 | 3.359 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b) | | 3.232 | 3.189 |
| France Government International Bond 1,100 % fällig am 25.07.2022 | € | 2.378 | 2.915 |
| France Government International Bond 0,250 % fällig am 25.07.2024 | | 1.643 | 1.987 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,375 % fällig am 15.01.2025 (b) | $ | 1.558 | 1.742 |
| | | **AKTIEN** | |
| Invesco Physical Gold ETC | | 12.828 | 1.693 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | $ | 1.671 | 1.676 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 1.606 | 1.656 |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.05.2026 | | 1.400 | 1.399 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2048 (b) | | 1.407 | 1.378 |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 10.08.2048 | £ | 592 | 1.276 |
| France Government International Bond 0,100 % fällig am 01.03.2025 | € | 1.039 | 1.257 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 30.04.2026 | $ | 1.100 | 1.099 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2024 (b) | | 1.092 | 1.087 |
| United Kingdom Gilt 0,125 % fällig am 22.11.2056 | £ | 398 | 981 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2020 (b) | $ | 960 | 942 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | | 970 | 938 |
| U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 900 | 901 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.01.2026 | | 900 | 901 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2023 (b) | | 904 | 899 |
| U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2026 | | 900 | 896 |
| U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2026 | | 900 | 895 |

(a) Der Inflation Strategy Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Average Duration Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b) | $ | 51.365 | $ 51.680 |
| **Fannie Mae Pool** 4,000 % fällig am 01.08.2048 | | 47.988 | 49.023 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,375 % fällig am 15.07.2023 (b) | | 45.471 | 45.456 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b) | | 38.088 | 37.239 |
| **Ginnie Mae** 5,000 % fällig am 20.02.2049 | | 24.734 | 25.893 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 1.709.831 | 17.121 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 16.441 | 16.945 |
| **Ginnie Mae** 5,000 % fällig am 20.03.2049 | | 11.475 | 12.021 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,375 % fällig am 31.05.2020 | | 9.900 | 9.804 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 6.500 | 8.593 |
| **Volkswagen Bank GmbH** 1,250 % fällig am 01.08.2022 | € | 7.200 | 8.235 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | $ | 7.510 | 7.433 |
| **Mulcair Securities DAC** 0,695 % fällig am 24.04.2071 | € | 4.600 | 5.175 |
| **Wells Fargo Bank N.A.** 3,141 % fällig am 27.05.2022 | $ | 4.200 | 4.200 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 5,139 % fällig am 07.01.2021 | | 3.700 | 3.700 |
| **Ginnie Mae** 5,000 % fällig am 20.04.2049 | | 3.210 | 3.365 |
| **UniCredit SpA** 6,497 % fällig am 14.01.2022 | | 3.200 | 3.200 |
| **Daimler Finance North America LLC** 3,403 % fällig am 22.02.2022 | | 3.000 | 3.000 |
| **Deutsche Bank AG** 5,000 % fällig am 14.02.2022 | | 3.000 | 2.999 |
| **Danske Bank A/S** 5,000 % fällig am 12.01.2022 | | 3.000 | 2.992 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| **Fannie Mae UMBS** 4,000 % fällig am 01.09.2048 | $ | 53.541 | $ 54.695 |
| **Ginnie Mae** 5,000 % fällig am 20.09.2048 | | 47.346 | 49.321 |
| **Fannie Mae Pool** 4,000 % fällig am 01.08.2048 | | 47.988 | 49.030 |
| **U.S. Treasury Notes** 1,375 % fällig am 31.05.2020 | | 19.800 | 19.611 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 1.887.628 | 18.900 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Private Export Funding Corp.** 2,100 % fällig am 19.12.2019 | $ | 12.000 | 11.903 |
| **Bank of America Corp.** 3,541 % fällig am 05.03.2024 | | 7.000 | 6.952 |
| **Citibank N.A.** 3,050 % fällig am 01.05.2020 | | 6.700 | 6.728 |
| **Citibank N.A.** 2,861 % fällig am 01.05.2020 | | 6.700 | 6.711 |
| **AT&T, Inc.** 3,733 % fällig am 30.06.2020 | | 6.500 | 6.552 |
| **American Express Credit Corp.** 2,375 % fällig am 26.05.2020 | | 6.351 | 6.334 |
| **Sumitomo Mitsui Banking Corp.** 2,799 % fällig am 17.01.2020 | | 6.000 | 6.011 |
| **Virgin Media Receivables Financing Notes DAC** 5,500 % fällig am 15.09.2024 | £ | 3.800 | 5.095 |
| **Toyota Motor Credit Corp.** 2,514 % fällig am 10.01.2020 | $ | 5.090 | 5.093 |
| **Skandinaviska Enskilda Banken AB** 3,349 % fällig am 13.09.2019 | | 5.000 | 5.013 |
| **National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.** 3,178 % fällig am 30.06.2021 | | 4.300 | 4.313 |
| **HSBC USA, Inc.** 3,228 % fällig am 13.11.2019 | | 4.050 | 4.065 |
| **Toyota Motor Credit Corp.** 3,040 % fällig am 17.05.2022 | | 4.000 | 4.010 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** 3,269 % fällig am 05.03.2023 | | 3.800 | 3.804 |
| **U.S. Bank N.A.** 2,737 % fällig am 24.07.2020 | | 3.600 | 3.605 |
| **Banco Santander Mexico S.A.** 25,500 % fällig am 17.07.2019 | ARS | 172.100 | 3.459 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 6.783.294 | $ 67.920 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2022 | $ | 33.900 | 34.008 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.04.2023 (b) | | 18.845 | 18.967 |
| U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 15.04.2022 | | 12.200 | 12.182 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b) | | 6.239 | 6.244 |
| JPMorgan Chase & Co. 2,776 % fällig am 25.04.2023 | | 5.000 | 5.015 |
| BNP Paribas S.A. 4,705 % fällig am 10.01.2025 | | 4.000 | 4.240 |
| U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.05.2024 | | 3.700 | 3.728 |
| SMBC Aviation Capital Finance DAC 3,550 % fällig am 15.04.2024 | | 3.330 | 3.329 |
| Morgan Stanley 0,637 % fällig am 26.07.2024 | € | 2.800 | 3.137 |
| Volkswagen Group of America Finance LLC 4,000 % fällig am 12.11.2021 | $ | 2.700 | 2.751 |
| Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,150 % fällig am 23.01.2025 | | 2.700 | 2.697 |
| Park Aerospace Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 15.08.2022 | | 2.500 | 2.612 |
| Aegon Bank NV 0,625 % fällig am 21.06.2024 | € | 2.300 | 2.569 |
| Citibank N.A. 3,123 % fällig am 20.05.2022 | $ | 2.500 | 2.500 |
| Penske Truck Leasing Co. LP 3,650 % fällig am 29.07.2021 | | 2.500 | 2.498 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 2.548 | 2.452 |
| Dell International LLC 5,450 % fällig am 15.06.2023 | | 2.300 | 2.420 |
| Constellation Brands, Inc. 2,650 % fällig am 07.11.2022 | | 2.400 | 2.389 |
| UCB S.A. 1,875 % fällig am 02.04.2022 | € | 2.000 | 2.354 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 6.790.993 | $ 68.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.03.2022 | $ | 25.400 | 25.414 |
| Conagra Brands, Inc. 3,800 % fällig am 22.10.2021 | | 3.700 | 3.756 |
| Volkswagen Group of America Finance LLC 2,450 % fällig am 20.11.2019 | | 3.423 | 3.416 |
| Duke Energy Corp. 3,028 % fällig am 14.05.2021 | | 3.000 | 2.998 |
| Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,150 % fällig am 23.01.2025 | | 2.700 | 2.726 |
| Dominion Energy Gas Holdings LLC 2,800 % fällig am 15.11.2020 | | 2.600 | 2.590 |
| DBS Group Holdings Ltd. 2,943 % fällig am 08.06.2020 | | 2.500 | 2.508 |
| Credit Suisse Group AG 1,000 % fällig am 24.06.2027 | € | 2.100 | 2.417 |
| Constellation Brands, Inc. 3,218 % fällig am 15.11.2021 | $ | 2.400 | 2.402 |
| Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % fällig am 01.02.2021 | | 2.300 | 2.385 |
| Toyota Tsusho Corp. 3,625 % fällig am 13.09.2023 | | 2.300 | 2.299 |
| Metropolitan Life Global Funding 2,990 % fällig am 07.09.2020 | | 2.300 | 2.298 |
| Saudi Government International Bond 2,875 % fällig am 04.03.2023 | | 2.200 | 2.158 |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 3,241 % fällig am 25.02.2022 | | 2.000 | 2.011 |
| Dominion Energy Gas Holdings LLC 3,010 % fällig am 15.06.2021 | | 2.000 | 2.010 |
| Deutsche Bank AG 1,750 % fällig am 16.12.2021 | £ | 1.600 | 2.001 |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,921 % fällig am 21.08.2020 | $ | 2.000 | 1.997 |
| BP Capital Markets PLC 2,518 % fällig am 16.01.2020 | | 2.000 | 1.993 |
| Banco Santander S.A. 3,125 % fällig am 23.02.2023 | | 2.000 | 1.953 |
| AutoNation, Inc. 3,350 % fällig am 15.01.2021 | | 1.905 | 1882 |
| Sands China Ltd. 4,600 % fällig am 08.08.2023 | | 1.800 | 1.877 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Low Duration Income Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 6.750 | $ 8.923 |
| **U.S. Treasury Bonds** 2,875 % fällig am 15.05.2049 | $ | 5.200 | 5.485 |
| **Carrington Mortgage Loan Trust** 3,064 % fällig am 25.06.2035 | | 5.000 | 4.756 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,375 % fällig am 15.05.2029 | | 4.300 | 4.391 |
| **Argentina Government International Bond** 63,705 % fällig am 21.06.2020 | ARS | 147.600 | 3.803 |
| **Taurus FR DAC** 1,000 % fällig am 02.02.2031 | € | 3.300 | 3.705 |
| **Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.** 6,125 % fällig am 07.02.2022 | $ | 3.385 | 3.598 |
| **HSI Asset Securitization Corp. Trust** 2,594 % fällig am 25.01.2037 | | 4.303 | 3.459 |
| **Deutsche Bank AG** 2,500 % fällig am 13.02.2019 | | 3.200 | 3.197 |
| **Atrium Hotel Portfolio Trust** 3,324 % fällig am 15.12.2036 | | 2.450 | 2.426 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 2.312 | 2.381 |
| **State Bank of India** 4,000 % fällig am 24.01.2022 | | 2.100 | 2.093 |
| **Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV** 2,200 % fällig am 21.07.2021 | | 2.113 | 1.996 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 191.089 | 1.913 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **Petrobras Global Finance BV** 8,750 % fällig am 23.05.2026 | $ | 1.346 | 1.600 |
| **Saudi Government International Bond** 4,000 % fällig am 17.04.2025 | | 1.500 | 1.541 |
| **Marlette Funding Trust** 3,440 % fällig am 16.04.2029 | | 1.500 | 1.500 |
| **Springleaf Finance Corp.** 7,750 % fällig am 01.10.2021 | | 1.276 | 1.391 |
| **Banca Carige SpA** 1,389 % fällig am 25.10.2021 | € | 1.100 | 1.244 |
| **Lloyds Banking Group PLC** 2,907 % fällig am 07.11.2023 | $ | 1.200 | 1.176 |
| **Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S** 5,800 % fällig am 21.02.2022 | | 1.140 | 1.140 |
| **Industrial & Commercial Bank of China Ltd.** 3,310 % fällig am 08.11.2020 | | 1.100 | 1.103 |
| **Pacific Gas & Electric Co.** 2,950 % fällig am 01.03.2026 | | 1.266 | 1.012 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| **Cigna Corp.** 3,400 % fällig am 17.09.2021 | $ 2.644 | $ 2.655 |
| **Progress Energy, Inc.** 4,400 % fällig am 15.01.2021 | 1.700 | 1.730 |
| **Crown Castle International Corp.** 3,400 % fällig am 15.02.2021 | 1.700 | 1.691 |
| **Pernod Ricard S.A.** 5,750 % fällig am 07.04.2021 | 1.500 | 1.573 |
| **Mizuho Financial Group, Inc.** 3,922 % fällig am 11.09.2024 | 1.500 | 1.550 |
| **Marlette Funding Trust** 3,440 % fällig am 16.04.2029 | 1.321 | 1.329 |
| **AbbVie, Inc.** 2,900 % fällig am 06.11.2022 | 1.076 | 1.068 |
| **Celgene Corp.** 3,550 % fällig am 15.08.2022 | 800 | 815 |
| **eBay, Inc.** 2,600 % fällig am 15.07.2022 | 822 | 810 |
| **Barclays PLC** 8,000 % fällig am 15.06.2024 | 600 | 611 |
| **Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.** 4,750 % fällig am 23.01.2029 | 528 | 536 |
| **Comcast Corp.** 3,038 % fällig am 15.04.2024 | 498 | 497 |
| **Terwin Mortgage Trust** 3,784 % fällig am 25.03.2035 | 507 | 457 |
| **CIT Group, Inc.** 5,250 % fällig am 07.03.2025 | 431 | 438 |
| **Avolon Holdings Funding Ltd.** 5,125 % fällig am 01.10.2023 | 350 | 353 |
| **Reckitt Benckiser Treasury Services PLC** 2,375 % fällig am 24.06.2022 | 300 | 294 |
| **Andeavor Logistics LP** 3,500 % fällig am 01.12.2022 | 274 | 276 |
| **Volkswagen Financial Services AG** 1,500 % fällig am 01.10.2024 | € 230 | 262 |
| **Fidelity National Information Services, Inc.** 3,360 % fällig am 21.05.2031 | £ 200 | 260 |
| **Kazakhstan Government International Bond** 2,375 % fällig am 09.11.2028 | € 200 | 233 |

(a) Der Low Duration Income 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | |
| Antero Midstream Corp. | 492.416 | $ 6.643 |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 635.251 | 6.361 |
| EnLink Midstream LLC | 531.450 | 5.793 |
| Transcanada Corp. | 85.000 | 3.879 |
| Williams Cos., Inc. | 140.500 | 3.829 |
| Targa Resources Corp. | 91.500 | 3.721 |
| Tallgrass Energy LP | 136.410 | 3.367 |
| Enbridge, Inc. | 70.000 | 2.607 |
| Valero Energy Corp. | 31.000 | 2.583 |
| Phillips 66 | 30.000 | 2.580 |
| Marathon Petroleum Corp. | 48.000 | 2.538 |
| ONEOK, Inc. | 33.000 | 2.176 |
| Cheniere Energy, Inc. | 19.000 | 1.244 |
| Kinder Morgan, Inc. | 48.000 | 940 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 419.467 | $ 4.200 |
| Targa Resources Corp. | 98.000 | 3.979 |
| ONEOK, Inc. | 57.000 | 3.690 |
| Phillips 66 | 30.000 | 2.723 |
| Williams Cos., Inc. | 88.000 | 2.435 |
| Kinder Morgan, Inc. | 125.000 | 2.296 |
| Cheniere Energy, Inc. | 28.500 | 1.806 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Mortgage Opportunities Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 64.146.721 | $ 642.260 |
| | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ 101.826 | 104.920 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.01.2026 | 70.700 | 70.903 |
| Ginnie Mae 4,500 % fällig am 20.04.2049 | 36.966 | 38.506 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2029 | 36.400 | 37.361 |
| Ginnie Mae 4,500 % fällig am 20.12.2048 | 33.681 | 34.996 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.12.2025 | 25.400 | 25.554 |
| U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2026 | 18.700 | 18.966 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | 18.000 | 17.948 |
| Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.01.2049 | 15.217 | 15.901 |
| Freddie Mac 5,000 % fällig am 01.03.2049 | 13.492 | 14.708 |
| Freddie Mac 3,500 % fällig am 15.06.2046 | 13.378 | 13.679 |
| Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.10.2048 | 12.792 | 13.302 |
| Freddie Mac 0,000 % fällig am 15.08.2057 | 17.655 | 13.142 |
| Fannie Mae UMBS 4,500 % fällig am 01.07.2048 | 11.058 | 11.492 |
| Fannie Mae UMBS 4,00 % fällig am 01.09.2037 | 11.074 | 11.446 |
| Ginnie Mae 3,000 % fällig am 20.12.2046 | 10.883 | 10.755 |
| Fannie Mae 3,660 % fällig am 01.02.2026 | 10.600 | 10.630 |
| Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.04.2049 | 7.628 | 8.002 |
| U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2026 | 7.900 | 7.857 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 58.608.657 | $ 586.805 |
| | **PARI (000S)** | |
| Freddie Mac 4,500 % fällig am 01.12.2048 | $ 204.011 | 211.382 |
| Fannie Mae UMBS 4,000 % fällig am 01.05.2047 | 49.001 | 50.551 |
| Fannie Mae 2,806 % fällig am 25.12.2048 | 40.483 | 40.278 |
| Fannie Mae UMBS 4,000 % fällig am 01.12.2048 | 33.943 | 34.649 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.01.2026 | 34.200 | 34.327 |
| Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.10.2038 | 27.388 | 28.158 |
| Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.09.2048 | 25.236 | 26.383 |
| Freddie Mac 2,649 % fällig am 15.10.2037 | 22.498 | 22.400 |
| Fannie Mae 3,000 % fällig am 25.05.2048 | 22.403 | 21.848 |
| Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.11.2046 | 20.716 | 21.593 |
| Ginnie Mae 2,649 % fällig am 20.08.2046 | 19.668 | 19.572 |
| Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.06.2038 | 18.999 | 19.534 |
| U.S. Treasury Notes 2,500 % fällig am 28.02.2026 | 18.700 | 19.174 |
| Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.09.2038 | 18.445 | 18.964 |
| Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.08.2047 | 17.757 | 18.387 |
| Fannie Mae 3,000 % fällig am 25.09.2048 | 18.663 | 18.138 |
| Fannie Mae 3,370 % fällig am 01.10.2025 | 17.584 | 17.954 |
| Fannie Mae 3,694 % fällig am 25.05.2048 | 16.614 | 16.461 |
| Fannie Mae 4,000 % fällig am 01.01.2049 | 14.800 | 15.108 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO RAE Emerging Markets Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | |
| Gazprom PJSC SP - ADR | 405.456 | $ 2.150 |
| China Construction Bank Corp. 'H' | 2.407.000 | 2.112 |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 40.597 | 1.629 |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 'H' | 2.118.000 | 1.607 |
| Bank of China Ltd. 'H' | 3.017.000 | 1.397 |
| Lukoil PJSC SP - ADR | 11.478 | 962 |
| China Mobile Ltd. | 88.000 | 875 |
| State Bank of India GDR | 16.440 | 734 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. SP - ADR | 18.854 | 726 |
| ICICI Bank Ltd. SP - ADR | 62.277 | 700 |
| China Petroleum & Chemical Corp. 'H' | 858.000 | 681 |
| Infosys Ltd. SP - ADR | 60.685 | 660 |
| Tata Motors Ltd. ADR | 49.159 | 612 |
| Korea Electric Power Corp. | 22.258 | 580 |
| Hyundai Motor Co. | 4.962 | 577 |
| KT Corp. SP - ADR | 42.899 | 570 |
| SK Telecom Co. Ltd. SP - ADR | 21.120 | 529 |
| Vedanta Ltd. ADR | 53.792 | 528 |
| CNOOC Ltd. | 297.000 | 522 |
| Hon Hai Precision Industry Co. Ltd. | 202.000 | 497 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| Gazprom PJSC SP - ADR | 351.688 | $ 1.785 |
| China Construction Bank Corp. 'H' | 1.743.000 | 1.506 |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 'H' | 1.735.000 | 1.273 |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 31.497 | 1.209 |
| Lukoil PJSC SP - ADR | 13.007 | 1.086 |
| Bank of China Ltd. 'H' | 2.139.000 | 984 |
| CNOOC Ltd. | 465.000 | 796 |
| Infosys Ltd. SP - ADR | 59.878 | 646 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. SP - ADR | 16.165 | 641 |
| China Mobile Ltd. | 64.500 | 632 |
| KT Corp. SP - ADR | 37.221 | 487 |
| SK Telecom Co. Ltd. SP - ADR | 18.800 | 468 |
| China Petroleum & Chemical Corp. 'H' | 588.000 | 457 |
| Hyundai Motor Co. | 3.988 | 448 |
| Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. 'H' | 37.000 | 414 |
| Vale S.A. | 31.400 | 395 |
| Kia Motors Corp. | 11.151 | 389 |
| China National Building Material Co. Ltd. 'H' | 472.000 | 382 |
| Sasol Ltd. | 12.615 | 382 |
| Korea Electric Power Corp. | 15.073 | 380 |

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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO RAE Europe Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | |
| BP PLC | 10.309 | € 66 |
| Banco Santander S.A. | 14.759 | 65 |
| Telefonica S.A. | 8.571 | 64 |
| GlaxoSmithKline PLC | 3.320 | 60 |
| Total S.A. | 1.146 | 56 |
| HSBC Holdings PLC | 7.143 | 56 |
| Nestle S.A. | 645 | 56 |
| Sanofi | 686 | 53 |
| Royal Dutch Shell PLC 'A' | 1.690 | 48 |
| Deutsche Bank AG | 6.553 | 47 |
| Eni SpA | 2.998 | 45 |
| Societe Generale S.A. | 1.607 | 43 |
| Novartis AG | 563 | 41 |
| BNP Paribas S.A. | 901 | 41 |
| Engie S.A. | 2.980 | 39 |
| Roche Holding AG | 168 | 39 |
| Daimler AG | 643 | 37 |
| Deutsche Telekom AG | 2.359 | 35 |
| Siemens AG | 343 | 35 |
| AstraZeneca PLC | 505 | 34 |
| Bayer AG | 573 | 33 |
| Volkswagen AG | 211 | 32 |
| Carrefour S.A. | 1.891 | 32 |
| Barclays PLC | 17.052 | 32 |
| BASF SE | 454 | 32 |
| AXA S.A. | 1.356 | 32 |
| Enel SpA | 5.644 | 31 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| HSBC Holdings PLC | 17.262 | € 127 |
| BP PLC | 17.404 | 108 |
| GlaxoSmithKline PLC | 5.612 | 98 |
| Royal Dutch Shell PLC 'A' | 3.370 | 95 |
| Sanofi | 1.131 | 86 |
| Novartis AG | 984 | 78 |
| Total S.A. | 1.579 | 77 |
| AstraZeneca PLC | 1.063 | 73 |
| Banco Santander S.A. | 16.125 | 66 |
| Nestle S.A. | 752 | 65 |
| Roche Holding AG | 260 | 62 |
| Telefonica S.A. | 7.917 | 59 |
| Volkswagen AG | 384 | 56 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 254 | 55 |
| Zurich Insurance Group AG | 187 | 55 |
| Enel SpA | 9.355 | 53 |
| Swiss Re AG | 608 | 53 |
| Daimler AG | 1.000 | 49 |
| Eni SpA | 3.353 | 49 |
| Engie S.A. | 3.715 | 49 |
| Barclays PLC | 25.045 | 45 |
| Lloyds Banking Group PLC | 62.183 | 43 |

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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO RAE Global Developed Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | |
| Apple, Inc. | 1.715 | $ 285 |
| Exxon Mobil Corp. | 3.098 | 233 |
| International Business Machines Corp. | 1.695 | 231 |
| General Electric Co. | 23.599 | 229 |
| Pfizer, Inc. | 5.247 | 217 |
| Verizon Communications, Inc. | 2.956 | 161 |
| Banco Santander S.A. | 34.122 | 161 |
| AT&T, Inc. | 5.144 | 158 |
| American International Group, Inc. | 3.697 | 156 |
| BP PLC | 22.182 | 153 |
| Walmart, Inc. | 1.564 | 152 |
| GlaxoSmithKline PLC | 7.499 | 150 |
| Merck & Co., Inc. | 1.864 | 143 |
| Nestle S.A. | 1.488 | 135 |
| Wells Fargo & Co. | 2.695 | 132 |
| TOTAL S.A. | 2.369 | 131 |
| Telefonica S.A. | 15.214 | 129 |
| HSBC Holdings PLC | 14.904 | 126 |
| Intel Corp. | 2.568 | 125 |
| Microsoft Corp. | 1.146 | 119 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| Apple, Inc. | 690 | $ 123 |
| Pfizer, Inc. | 2.665 | 112 |
| Exxon Mobil Corp. | 1.328 | 95 |
| Walmart, Inc. | 700 | 70 |
| Chevron Corp. | 584 | 66 |
| Anthem, Inc. | 223 | 65 |
| Target Corp. | 825 | 64 |
| Intel Corp. | 1.162 | 59 |
| Microsoft Corp. | 501 | 59 |
| AbbVie, Inc. | 735 | 57 |
| UnitedHealth Group, Inc. | 216 | 52 |
| GlaxoSmithKline PLC | 2.550 | 49 |
| Thomson Reuters Corp. | 928 | 49 |
| American Express Co. | 427 | 48 |
| Cisco Systems, Inc. | 875 | 45 |
| ConocoPhillips | 731 | 43 |
| Walt Disney Co. | 362 | 42 |
| Berkshire Hathaway, Inc. 'B' | 203 | 41 |
| Cigna Corp. | 230 | 38 |
| Kohl's Corp. | 656 | 38 |
| HCA Healthcare, Inc. | 302 | 38 |
| Marathon Petroleum Corp. | 707 | 38 |

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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | $ | 4.200 | $ 4.200 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 799 | 820 |
| U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 400 | 399 |
| Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 | ¥ | 20.123 | 189 |
| Comcast Corp. 3,950 % fällig am 15.10.2025 | $ | 102 | 106 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.07.2025 (b) | | 64 | 64 |
| Argentina Government International Bond 59,257 % fällig am 21.06.2020 | ARS | 420 | 12 |
| Argentina Government International Bond 50,225 % fällig am 03.04.2022 | | 20 | 0 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 33 | 0 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 37.100 | $ 3.758 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | $ | 1.400 | 1.417 |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 15.05.2025 | | 1.200 | 1.211 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 1.070 | 1.057 |
| Saxon Asset Securities Trust 2,956 % fällig am 25.11.2037 | | 900 | 862 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,500 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 709 | 839 |
| Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 | ¥ | 80.584 | 764 |
| Residential Asset Mortgage Products Trust 2,846 % fällig am 25.03.2036 | $ | 800 | 763 |
| Conagra Brands, Inc. 2,908 % fällig am 09.10.2020 | | 700 | 698 |
| Bear Stearns ALT-A Trust 4,649 % fällig am 25.11.2035 | | 691 | 657 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 601 | 621 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | | 526 | 523 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | | 405 | 416 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust 2,656 % fällig am 25.09.2036 | | 460 | 346 |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 2,816 % fällig am 25.06.2037 | | 355 | 333 |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 3,127 % fällig am 25.05.2046 | | 390 | 325 |
| Aegis Asset-Backed Securities Trust 3,015 % fällig am 25.03.2035 | | 300 | 282 |
| Countrywide Alternative Loan Trust 6,000 % fällig am 25.12.2035 | | 285 | 270 |
| Countrywide Asset-Backed Certificates 2,646 % fällig am 25.06.2037 | | 256 | 236 |
| IndyMac Mortgage Loan Trust 2,776 % fällig am 25.10.2036 | | 349 | 234 |
| Dexia Credit Local S.A. 1,375 % fällig am 18.09.2019 | € | 200 | 226 |
| Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 4,667 % fällig am 20.02.2036 | $ | 245 | 225 |
| Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates 3,406 % fällig am 25.10.2034 | | 215 | 215 |

(a) Der PIMCO RAE PLUS Emerging Markets 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | | |
| U.S. Treasury Notes 2,250 % fällig am 31.03.2026 | $ | 40.500 | $ | 40.116 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 15.700 | | 15.701 |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.03.2024 | | 15.500 | | 15.369 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 4.695 | | 4.817 |
| U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 2.800 | | 2.790 |
| Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 | ¥ | 271.661 | | 2.551 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 0,112 % fällig am 07.12.2022 | € | 1.600 | | 1.695 |
| Fannie Mae UMBS, TBA 3,500 % fällig am 01.03.2049 | $ | 1.339 | | 1.351 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 5,345 % fällig am 07.01.2020 | | 1.200 | | 1.200 |
| Argentina Government International Bond 59,257 % fällig am 21.06.2020 | ARS | 1.100 | | 29 |
| Argentina Treasury Bills 0,000 % fällig am 28.02.2019 | | 157 | | 5 |
| Argentina Government International Bond 50,225 % fällig am 03.04.2022 | | 110 | | 2 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 15 | | 0 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | | |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.12.2021 | $ | 43.200 | $ | 43.517 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 189.570 | | 19.224 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 2,000 % fällig am 15.01.2026 (b) | $ | 8.248 | | 9.013 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 6.500 | | 6.498 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,375 % fällig am 15.01.2027 (b) | | 5.681 | | 5.646 |
| Japan Government International Bond 0,100 % fällig am 10.03.2028 | ¥ | 554.015 | | 5.255 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | $ | 5.080 | | 4.975 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | | 4.716 | | 4.873 |
| Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust 2,816 % fällig am 25.06.2037 | | 4.724 | | 4.425 |
| Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 3,375 % fällig am 20.03.2024 | | 3.700 | | 3.924 |
| IndyMac Mortgage Loan Trust 2,776 % fällig am 25.10.2036 | | 5.678 | | 3.809 |
| Bear Stearns ALT-A Trust 2,666 % fällig am 25.06.2046 | | 3.430 | | 3.621 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 3.448 | | 3.376 |
| MASTR Asset-Backed Securities Trust 3,656 % fällig am 25.08.2037 | | 3.755 | | 3.351 |
| Dexia Credit Local S.A. 2,000 % fällig am 22.01.2021 | € | 2.700 | | 3.152 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.01.2022 (b) | $ | 3.154 | | 3.126 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | | 3.037 | | 3.120 |
| Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 2,726 % fällig am 25.10.2037 | | 4.091 | | 2.989 |
| Long Beach Mortgage Loan Trust 2,656 % fällig am 25.09.2036 | | 3.825 | | 2.880 |
| WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust 2,926 % fällig am 25.05.2044 | | 2.122 | | 2.114 |
| Option One Mortgage Loan Trust 2,866 % fällig am 25.01.2036 | | 2.100 | | 1.917 |
| Fremont Home Loan Trust 2,656 % fällig am 25.10.2036 | | 3.635 | | 1.802 |

(a) Der PIMCO RAE PLUS Global Developed 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

Auf null lautende Saldi können für faktisch vorhandene Beträge stehen, wenn ihr Rundungsbetrag unter tausend liegt.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO RAE US Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | |
| General Electric Co. | 3.994 | $ 41 |
| Wells Fargo & Co. | 786 | 36 |
| Exxon Mobil Corp. | 420 | 33 |
| International Business Machines Corp. | 235 | 32 |
| Procter & Gamble Co. | 301 | 31 |
| Comcast Corp. 'A' | 667 | 27 |
| AT&T, Inc. | 752 | 23 |
| Duke Energy Corp. | 259 | 23 |
| Altria Group, Inc. | 380 | 19 |
| Citigroup, Inc. | 287 | 18 |
| Southern Co. | 339 | 18 |
| QUALCOMM, Inc. | 312 | 17 |
| CenturyLink, Inc. | 1.368 | 16 |
| Philip Morris International, Inc. | 189 | 16 |
| Merck & Co., Inc. | 184 | 15 |
| Franklin Resources, Inc. | 436 | 15 |
| American Airlines Group, Inc. | 482 | 14 |
| Exelon Corp. | 297 | 14 |
| PepsiCo, Inc. | 110 | 14 |
| Kinder Morgan, Inc. | 658 | 13 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| Chevron Corp. | 273 | $ 31 |
| Apple, Inc. | 179 | 31 |
| Dominion Energy, Inc. | 331 | 24 |
| Exxon Mobil Corp. | 332 | 23 |
| Bausch Health Cos., Inc. | 1.083 | 23 |
| Caterpillar, Inc. | 180 | 23 |
| Microsoft Corp. | 199 | 23 |
| AbbVie, Inc. | 284 | 22 |
| Walt Disney Co. | 200 | 22 |
| Northrop Grumman Corp. | 73 | 22 |
| Marathon Petroleum Corp. | 393 | 22 |
| UnitedHealth Group, Inc. | 87 | 21 |
| Cigna Corp. | 123 | 20 |
| Kohl's Corp. | 350 | 20 |
| Intel Corp. | 385 | 20 |
| ConocoPhillips | 306 | 18 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | 179 | 18 |
| JPMorgan Chase & Co. | 164 | 17 |
| Anthem, Inc. | 57 | 17 |
| Bank of America Corp. | 565 | 16 |
| Pfizer, Inc. | 384 | 16 |
| Deere & Co. | 111 | 16 |
| Raytheon Co. | 83 | 15 |
| Alphabet, Inc. 'C' | 13 | 15 |
| Cisco Systems, Inc. | 268 | 14 |
| L3 Technologies, Inc. | 59 | 14 |
| Abbott Laboratories | 176 | 14 |
| HCA Healthcare, Inc. | 103 | 13 |
| Tenet Healthcare Corp. | 511 | 13 |
| Home Depot, Inc. | 68 | 13 |
| Valero Energy Corp. | 171 | 12 |
| TransDigm Group, Inc. | 27 | 12 |

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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | |
| Samsung Electronics Co. Ltd. | 3.009 | $ 118 |
| Naspers Ltd. 'N' | 404 | 94 |
| State Bank of India GDR | 1.430 | 67 |
| ICICI Bank Ltd. SP - ADR | 2.755 | 32 |
| Infosys Ltd. SP - ADR | 2.465 | 26 |
| GAIL India Ltd. | 830 | 25 |
| Hyundai Mobis Co. Ltd. | 135 | 25 |
| Dr Reddy's Laboratories Ltd. ADR | 596 | 24 |
| Wipro Ltd. ADR | 5.689 | 23 |
| Shinhan Financial Group Co. Ltd. | 431 | 16 |
| China Life Insurance Co. Ltd. 'H' | 5.000 | 13 |
| Kia Motors Corp. | 415 | 13 |
| China Shenhua Energy Co. Ltd. 'H' | 5.500 | 13 |
| Yum China Holdings, Inc. | 269 | 12 |
| HDFC Bank Ltd. ADR | 104 | 12 |
| HAP Seng Consolidated Bhd. | 4.700 | 11 |
| Great Wall Motor Co. Ltd. 'H' | 15.000 | 11 |
| Hankook Tire & Technology Co. Ltd. | 341 | 11 |
| Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. | 41 | 11 |
| Cencosud S.A. | 5.838 | 10 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd. SP - ADR | 2.980 | $ 122 |
| Mahindra & Mahindra Ltd. GDR | 8.800 | 85 |
| China Construction Bank Corp. 'H' | 89.000 | 76 |
| Vale S.A. SP - ADR | 5.759 | 75 |
| Lukoil PJSC SP - ADR | 527 | 47 |
| Tata Motors Ltd. ADR | 3.672 | 46 |
| Gazprom PJSC | 14.770 | 34 |
| China Petroleum & Chemical Corp. 'H' | 38.000 | 30 |
| Petroleo Brasileiro S.A. SP - ADR | 1.600 | 25 |
| Woori Financial Group, Inc. | 1.800 | 22 |
| MTN Group Ltd. | 2.718 | 17 |
| Standard Bank Group Ltd. | 1.251 | 16 |
| Tata Steel Ltd. GDR | 2.100 | 16 |
| CNOOC Ltd. | 8.000 | 15 |
| CSPC Pharmaceutical Group Ltd. | 8.000 | 15 |
| POSCO | 64 | 14 |
| Agricultural Bank of China Ltd. 'H' | 28.000 | 13 |
| America Movil S.A.B. de C.V. SP - ADR 'L' | 847 | 12 |
| China Mengniu Dairy Co. Ltd. | 3.000 | 11 |
| PTT PCL | 6.700 | 10 |

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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor Europe Equity Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | |
| Nestle S.A. | 378 | € 32 |
| AXA S.A. | 635 | 14 |
| RELX PLC | 676 | 13 |
| Telefonica S.A. | 1.702 | 13 |
| Industria de Diseno Textil S.A. | 406 | 11 |
| 3i Group PLC | 771 | 9 |
| Zurich Insurance Group AG | 30 | 9 |
| Legal & General Group PLC | 2.425 | 8 |
| Volvo AB 'B' | 562 | 8 |
| Imperial Brands PLC | 240 | 7 |
| Enel SpA | 1.272 | 7 |
| Rolls-Royce Holdings PLC | 643 | 7 |
| Innogy SE | 173 | 7 |
| Kerry Group PLC 'A' | 59 | 6 |
| Banco Santander S.A. | 1.413 | 6 |
| Telecom Plus PLC | 319 | 5 |
| Rio Tinto PLC | 99 | 5 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 20 | 5 |
| Airbus SE | 43 | 5 |
| Ferrovial S.A. | 238 | 5 |
| Diageo PLC | 135 | 5 |
| Hannover Rueck SE | 39 | 5 |
| Swiss Life Holding AG | 12 | 5 |
| Tullow Oil PLC | 1.634 | 5 |
| Baloise Holding AG | 31 | 5 |
| Medtronic PLC | 58 | 5 |
| adidas AG | 21 | 5 |
| Brenntag AG | 99 | 5 |
| Colruyt S.A. | 70 | 5 |
| BASF SE | 69 | 5 |
| James Hardie Industries PLC ADR | 393 | 5 |
| Koninklijke DSM NV | 45 | 5 |
| DSV A/S | 61 | 4 |
| Suedzucker AG | 332 | 4 |
| S.A.S. AB | 2.501 | 4 |
| ASR Nederland NV | 121 | 4 |
| BP PLC | 736 | 4 |
| RSA Insurance Group PLC | 755 | 4 |
| CNH Industrial NV | 493 | 4 |
| Inmarsat PLC | 690 | 4 |
| EDP - Energias de Portugal S.A. | 1.274 | 4 |
| Cie Financiere Richemont S.A. | 67 | 4 |
| El Group PLC | 1.796 | 4 |
| Helvetia Holding AG | 8 | 4 |
| METRO AG | 301 | 4 |
| Naturgy Energy Group S.A. | 176 | 4 |
| Koninklijke KPN NV | 1.574 | 4 |
| Halma PLC | 228 | 4 |
| RWE AG | 186 | 4 |
| Vonovia SE | 96 | 4 |
| Rentokil Initial PLC | 1.008 | 4 |
| Akzo Nobel NV | 56 | 4 |
| Atlas Copco AB 'A' | 166 | 4 |
| Roche Holding AG | 18 | 4 |
| Air France-KLM | 439 | 4 |
| Anglo American PLC | 198 | 4 |
| Micro Focus International PLC | 189 | 4 |
| Nokia Oyj | 865 | 4 |
| Dunelm Group PLC | 430 | 4 |
| Uniper SE | 162 | 4 |
| Centrica PLC | 3.260 | 4 |
| Telenor ASA | 247 | 4 |
| Go-Ahead Group PLC | 187 | 4 |
| Hochtief AG | 31 | 4 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| GlaxoSmithKline PLC | 889 | € 16 |
| ASML Holding NV | 85 | 14 |
| BP PLC | 2.103 | 14 |
| Unilever PLC | 180 | 9 |
| Pernod Ricard S.A. | 53 | 8 |
| Royal Dutch Shell PLC 'A' | 298 | 8 |
| Siemens AG | 85 | 8 |
| Orange S.A. | 538 | 8 |
| EssilorLuxottica S.A. | 63 | 6 |
| Rhoen Klinikum AG | 200 | 5 |
| Aker BP ASA | 158 | 5 |
| James Hardie Industries PLC | 429 | 5 |
| Hexagon AB | 105 | 5 |
| Equinor ASA | 248 | 5 |
| Electricite de France S.A. | 380 | 5 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 14 | 5 |
| Merlin Properties Socimi S.A. | 391 | 5 |
| UPM-Kymmene Oyj | 175 | 5 |
| Capgemini SE | 42 | 5 |
| Danone S.A. | 66 | 5 |
| SAP SE | 44 | 5 |
| Glencore PLC | 1.228 | 5 |
| Swiss Re AG | 52 | 5 |
| British American Tobacco PLC | 122 | 5 |
| NN Group NV | 122 | 5 |
| Ashtead Group PLC | 210 | 5 |
| Volkswagen AG | 32 | 4 |
| Eurazeo S.A. | 67 | 4 |
| Hannover Rueck SE | 35 | 4 |
| Scout24 AG | 97 | 4 |
| Jazz Pharmaceuticals PLC | 35 | 4 |
| Johnson Matthey PLC | 122 | 4 |
| Publicis Groupe S.A. | 93 | 4 |
| Tieto OYJ | 163 | 4 |
| Koninklijke BAM Groep NV | 1.146 | 4 |
| Vodafone Group PLC | 2.693 | 4 |
| Galp Energia SGPS SA | 305 | 4 |
| Demant A/S | 165 | 4 |
| Sofina S.A. | 25 | 4 |
| Northgate PLC | 997 | 4 |
| Taylor Wimpey PLC | 2.119 | 4 |
| Eiffage S.A. | 50 | 4 |
| AstraZeneca PLC | 60 | 4 |
| Mercialys S.A. | 341 | 4 |
| Novozymes A/S | 102 | 4 |
| Dart Group PLC | 391 | 4 |
| VEON Ltd. ADR | 1.792 | 3 |
| CYBG PLC | 1.410 | 3 |
| Cimpress NV | 43 | 3 |

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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | |
| Procter & Gamble Co. | 229 | $ 24 |
| PepsiCo, Inc. | 124 | 15 |
| Exxon Mobil Corp. | 156 | 13 |
| McDonald's Corp. | 65 | 12 |
| International Business Machines Corp. | 85 | 12 |
| Nestle S.A. | 121 | 11 |
| AT&T, Inc. | 364 | 11 |
| Oriental Land Co. Ltd. | 100 | 11 |
| Walmart, Inc. | 100 | 10 |
| East Japan Railway Co. | 100 | 10 |
| Comcast Corp. | 218 | 9 |
| Coca-Cola Co. | 157 | 7 |
| Philip Morris International, Inc. | 82 | 7 |
| Fujitsu Ltd. | 100 | 7 |
| BHP Group PLC | 270 | 7 |
| RELX PLC | 302 | 6 |
| Merck & Co., Inc. | 86 | 6 |
| Sotetsu Holdings, Inc. | 200 | 6 |
| Johnson & Johnson | 42 | 6 |
| Suzuken Co. Ltd. | 100 | 6 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| Apple, Inc. | 162 | $ 31 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 100 | 20 |
| Intel Corp. | 288 | 15 |
| UnitedHealth Group, Inc. | 60 | 15 |
| Cigna Corp. | 78 | 13 |
| GlaxoSmithKline PLC | 420 | 9 |
| BP PLC | 1.147 | 8 |
| Japan Prime Realty Investment Corp. | 2 | 8 |
| Seven & i Holdings Co. Ltd. | 200 | 8 |
| Danone S.A. | 96 | 7 |
| Fair Isaac Corp. | 27 | 7 |
| Shiseido Co. Ltd. | 100 | 7 |
| AGC, Inc. | 200 | 7 |
| Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd. | 200 | 7 |
| Nippon Building Fund, Inc. | 1 | 7 |
| Beiersdorf AG | 64 | 7 |
| Royal Dutch Shell PLC 'A' | 210 | 7 |
| Vinci S.A. | 67 | 7 |
| Coloplast A/S 'B' | 59 | 6 |
| Keio Corp. | 100 | 6 |
| Fisher & Paykel Healthcare Corp. Ltd. | 584 | 6 |
| Nippon Paper Industries Co. Ltd. | 300 | 6 |
| Moody's Corp. | 34 | 6 |
| Dana, Inc. | 347 | 6 |
| ASTM SpA | 225 | 6 |
| Edwards Lifesciences Corp. | 32 | 6 |
| Occidental Petroleum Corp. | 91 | 6 |
| AIA Group Ltd. | 600 | 6 |
| Zoetis, Inc. | 59 | 6 |
| S&P Global, Inc. | 28 | 6 |
| Dream Industrial Real Estate Investment Trust | 660 | 6 |
| WABCO Holdings, Inc. | 44 | 6 |
| Ambac Financial Group, Inc. | 319 | 6 |
| Capstead Mortgage Corp. | 667 | 6 |
| DBS Group Holdings Ltd. | 300 | 6 |
| Spire, Inc. | 66 | 5 |
| ITOCHU Corp. | 300 | 5 |
| Swedish Match AB | 106 | 5 |
| Crombie Real Estate Investment Trust | 501 | 5 |
| Arrow Electronics, Inc | 69 | 5 |
| Plexus Corp. | 87 | 5 |
| NorthWest Healthcare Properties Real Estate Investment Trust | 607 | 5 |
| Extendicare, Inc. | 937 | 5 |
| Accenture PLC 'A' | 30 | 5 |
| Mitsubishi Materials Corp. | 200 | 5 |
| salesforce.com, Inc, | 33 | 5 |
| DNB ASA | 282 | 5 |
| Home Depot, Inc. | 27 | 5 |
| World Fuel Services Corp. | 179 | 5 |
| Visa, Inc. 'A' | 33 | 5 |
| Kesko OYJ 'B' | 84 | 5 |
| Capgemini SE | 42 | 5 |
| Glencore PLC | 1.228 | 5 |
| Cisco Systems, Inc. | 94 | 5 |
| TELUS Corp. | 137 | 5 |
| Microsoft Corp. | 43 | 5 |

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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO RAFI Dynamic Multi-Factor U.S. Equity Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | |
| Procter & Gamble Co. | 220 | $ 23 |
| Exxon Mobil Corp. | 182 | 15 |
| PepsiCo, Inc. | 98 | 12 |
| McDonald's Corp. | 57 | 11 |
| Comcast Corp. 'A' | 240 | 10 |
| AT&T, Inc. | 252 | 8 |
| Walmart, Inc. | 74 | 7 |
| Honeywell International, Inc. | 44 | 7 |
| Johnson & Johnson | 49 | 7 |
| Broadcom, Inc. | 21 | 6 |
| Oracle Corp. | 109 | 6 |
| Verizon Communications, Inc. | 88 | 5 |
| Celgene Corp. | 52 | 5 |
| Linde PLC | 27 | 5 |
| Kimberly-Clark Corp. | 37 | 5 |
| Philip Morris International, Inc. | 51 | 4 |
| CVS Health Corp. | 77 | 4 |
| Walt Disney Co. | 35 | 4 |
| Tesla, Inc. | 13 | 4 |
| Altria Group, Inc. | 60 | 3 |
| Aon PLC | 19 | 3 |
| Charter Communications, Inc. 'A' | 8 | 3 |
| Woodward, Inc. | 29 | 3 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| Apple, Inc. | 182 | $ 35 |
| Berkshire Hathaway, Inc. | 145 | 29 |
| UnitedHealth Group, Inc. | 77 | 19 |
| Intel Corp. | 345 | 19 |
| Cigna Corp. | 69 | 11 |
| Accenture PLC 'A' | 47 | 8 |
| Amazon.com, Inc. | 4 | 7 |
| Visa, Inc. 'A' | 43 | 7 |
| Microsoft Corp. | 53 | 6 |
| Zoetis, Inc. | 54 | 5 |
| International Business Machines Corp. | 35 | 5 |
| Huntington Ingalls Industries, Inc. | 22 | 5 |
| Mastercard, Inc. 'A' | 19 | 4 |
| Occidental Petroleum Corp. | 61 | 4 |
| Amcor PLC | 316 | 4 |
| Cisco Systems, Inc. | 63 | 3 |
| Allergan PLC | 23 | 3 |
| Pfizer, Inc. | 76 | 3 |
| Bausch Health Cos., Inc. | 121 | 3 |
| S&P Global, Inc. | 14 | 3 |
| Emerson Electric Co. | 43 | 3 |
| NextEra Energy, Inc. | 14 | 3 |

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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Socially Responsible Emerging Markets Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 18.212.689 | $ 182.357 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 9,250 % fällig am 23.04.2019 | $ | 14.300 | 14.459 |
| Tencent Holdings Ltd. 3,975 % fällig am 11.04.2029 | | 8.800 | 8.843 |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 5.500 | 5.500 |
| Russia Government International Bond 5,100 % fällig am 28.03.2035 | | 5.000 | 5.127 |
| Nigeria Government International Bond 7,625 % fällig am 21.11.2025 | | 4.700 | 4.783 |
| Brazil Minas SPE via State of Minas Gerais 5,333 % fällig am 15.02.2028 | | 4.470 | 4.592 |
| Ecuador Government International Bond 10,750 % fällig am 31.01.2029 | | 4.200 | 4.404 |
| Serbia Government International Bond 1,500 % fällig am 26.06.2029 | € | 3.800 | 4.215 |
| Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 5,800 % fällig am 21.02.2022 | $ | 4.000 | 4.000 |
| Qatar Government International Bond 3,375 % fällig am 14.03.2024 | | 3.900 | 3.930 |
| Qatar Government International Bond 4,817 % fällig am 14.03.2049 | | 3.800 | 3.800 |
| Qatar Government International Bond 4,000 % fällig am 14.03.2029 | | 3.800 | 3.787 |
| Ukraine Government International Bond 6,750 % fällig am 20.06.2026 | € | 3.200 | 3.607 |
| Petroleos Mexicanos 5,500 % fällig am 27.06.2044 | $ | 4.300 | 3.463 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 5,150 % fällig am 11.02.2026 | | 3.400 | 3.400 |
| Kenya Government International Bond 7,000 % fällig am 22.05.2027 | | 3.300 | 3.300 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 3.200 | 3.182 |
| Uruguay Government International Bond 4,375 % fällig am 23.01.2031 | | 2.949 | 2.926 |
| Russia Government International Bond 4,375 % fällig am 21.03.2029 | | 2.800 | 2.895 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN / PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 19.874.630 | $ 199.000 |
| Sinopec Group Overseas Development Ltd. 3,250 % fällig am 13.09.2027 | $ | 5.800 | 5.644 |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 5.500 | 5.545 |
| Brazil Government International Bond 4,250 % fällig am 07.01.2025 | | 4.800 | 4.812 |
| SASOL Financing USA LLC 5,875 % fällig am 27.03.2024 | | 3.900 | 4.167 |
| Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 3,400 % fällig am 29.03.2022 | | 3.500 | 3.514 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 3.200 | 3.181 |
| U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.11.2048 | | 2.700 | 2.861 |
| Indonesia Government International Bond 4,750 % fällig am 11.02.2029 | | 2.400 | 2.504 |
| South Africa Government International Bond 4,875 % fällig am 14.04.2026 | | 2.500 | 2.498 |
| Argentina Government International Bond 7,820 % fällig am 31.12.2033 | € | 2.477 | 2.350 |
| Petroleos de Venezuela S.A. 5,375 % fällig am 12.04.2027 | $ | 11.120 | 2.118 |
| LLPL Capital Pte Ltd. 6,875 % fällig am 04.02.2039 | | 1.800 | 2.046 |
| Mexico Government International Bond 4,600 % fällig am 10.02.2048 | | 1.900 | 1.758 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 29.02.2024 | | 1.700 | 1.690 |
| Israel Government International Bond 3,250 % fällig am 17.01.2028 | | 1.600 | 1.655 |
| Argentina Government International Bond 8,280 % fällig am 31.12.2033 | | 2.103 | 1.613 |
| CFLD Cayman Investment Ltd. 8,625 % fällig am 28.02.2021 | | 1.400 | 1.437 |
| Uruguay Government International Bond 4,375 % fällig am 27.10.2027 | | 1.309 | 1.339 |
| Poland Government International Bond 3,250 % fällig am 06.04.2026 | | 1.300 | 1.332 |

(a) Der Socially Responsible 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des StocksPLUS™ Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | | |
| **U.S. Treasury Note** 1,375 % fällig am 30.09.2023 | $ | 85.100 | $ | 82.238 |
| **U.S. Treasury Note** 2,625 % fällig am 15.02.2029 | | 29.600 | | 29.506 |
| **U.S. Treasury Inflation Indexed Bonds** 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a) | | 20.650 | | 19.866 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,375 % fällig am 15.11.2048 | | 17.300 | | 18.311 |
| **Japan Government International Bond** 0,100 % fällig am 10.03.2028 | ¥ | 1.921.746 | | 18.046 |
| **U.S. Treasury Inflation Protected Securities** 0,625 % fällig am 15.01.2026 (a) | $ | 14.006 | | 13.716 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 13.000 | | 12.952 |
| **Fannie Mae** 4,000 % fällig am 01.06.2048 | | 12.029 | | 12.486 |
| **Fannie Mae** 4,000 % fällig am 01.06.2047 | | 10.031 | | 10.420 |
| **Towd Point Mortgage Funding PLC** 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 7.800 | | 10.312 |
| **U.S. Treasury Notes** 3,000 % fällig am 31.10.2025 | $ | 9.600 | | 10.008 |
| **U.S. Treasury Notes** 3,000 % fällig am 30.09.2025 | | 9.600 | | 10.004 |
| **Santander UK PLC** 2,875 % fällig am 18.06.2024 | | 8.300 | | 8.269 |
| **Fannie Mae** 4,000 % fällig am 01.06.2049 | | 6.489 | | 6.739 |
| **Aroundtown S.A.** 5,375 % fällig am 21.03.2029 | | 6.500 | | 6.449 |
| **Deutsche Bank AG** 1,625 % fällig am 12.02.2021 | € | 5.100 | | 5.817 |
| **Horse Gallop Finance Ltd.** 3,250 % fällig am 30.05.2022 | $ | 5.800 | | 5.792 |
| **IHO Verwaltungs GmbH (4,735 % PIK)** 3,625 % fällig am 15.05.2025 | € | 3.500 | | 3.903 |
| **U.S. Treasury Notes** 2,625 % fällig am 31.12.2025 | $ | 3.800 | | 3.880 |
| **Octagon Investment Partners Ltd.** 3,447 % fällig am 15.07.2027 | | 3.700 | | 3.694 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | | |
| **U.S. Treasury Note** 2,625 % fällig am 15.02.2029 | $ | 29.600 | $ | 29.592 |
| **U.S. Treasury Inflation Indexed Bonds** 0,250 % fällig am 15.01.2025 (a) | | 20.883 | | 20.736 |
| **U.S. Treasury Bonds** 3,375 % fällig am 15.11.2048 | | 17.300 | | 20.183 |
| **Volkswagen Financial Services AG** 0,250 % fällig am 16.10.2020 | € | 6.600 | | 7.450 |
| **Kraft Heinz Foods Co.** 3,021 % fällig am 09.08.2019 | $ | 2.750 | | 2.751 |
| **U.S. Treasury Note** 2,750 % fällig am 31.08.2025 | | 2.700 | | 2.717 |
| **Delta Air Lines, Inc.** 3,625 % fällig am 15.03.2022 | | 2.100 | | 2.110 |
| **BAT Capital Corp.** 2,297 % fällig am 14.08.2020 | | 1.600 | | 1.576 |
| **Aircastle Ltd.** 5,500 % fällig am 15.02.2022 | | 1.400 | | 1.476 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 5,750 % fällig am 01.02.2021 | | 1.400 | | 1.447 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 2,343 % fällig am 02.11.2020 | | 1.400 | | 1.364 |
| **CVS Health Corp.** 2,750 % fällig am 01.12.2022 | | 1.100 | | 1.063 |
| **CVS Health Corp.** 4,750 % fällig am 01.12.2022 | | 1.000 | | 1.034 |
| **FCE Bank PLC** 0,869 % fällig am 13.09.2021 | € | 900 | | 1.006 |
| **AbbVie, Inc.** 3,200 % fällig am 06.11.2022 | $ | 1.000 | | 995 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 3,200 % fällig am 15.01.2021 | | 900 | | 894 |
| **Molson Coors Brewing Co.** 2,100 % fällig am 15.07.2021 | | 900 | | 884 |
| **Warner Media LLC** 3,400 % fällig am 15.06.2022 | | 800 | | 801 |
| **Pernod Ricard S.A.** 5,750 % fällig am 07.04.2021 | | 645 | | 676 |
| **Ford Motor Credit Co. LLC** 5,875 % fällig am 02.08.2021 | | 600 | | 627 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 50.062 | $ 501 |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity Source UCITS ETF (a) | 3.800 | 385 |
| | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ 299 | 309 |
| Mortgage Equity Conversion Asset Trust 2,880 % fällig am 25.02.2042 | 221 | 201 |
| Huarong Finance Co. Ltd. 4,000 % fällig am 17.07.2019 | 200 | 200 |
| China Construction Bank Asia Corp. Ltd. 3,250 % fällig am 02.07.2019 | 200 | 200 |
| Horse Gallop Finance Ltd. 3,250 % fällig am 30.05.2022 | 200 | 200 |
| Sprint Corp. 7,250 % fällig am 15.09.2021 | 150 | 157 |
| DISH DBS Corp. 7,875 % fällig am 01.09.2019 | 100 | 102 |
| GSMPS Mortgage Loan Trust 7,500 % fällig am 25.01.2036 | 100 | 100 |
| Edison International 5,750 % fällig am 15.06.2027 | 100 | 100 |
| Norbord, Inc. 5,750 % fällig am 15.07.2027 | 100 | 100 |
| Staples, Inc. 7,500 % fällig am 15.04.2026 | 100 | 100 |
| Allied Universal Holdco LLC 6,625 % fällig am 15.07.2026 | 100 | 100 |
| GSAA Home Equity Trust 4,279 % fällig am 25.02.2035 | 100 | 98 |
| Freddie Mac 3,488 % fällig am 25.02.2045 | 98 | 97 |
| Banc of America Alternative Loan Trust 5,500 % fällig am 25.10.2020 | 62 | 60 |
| Park Aerospace Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 15.08.2022 | 50 | 52 |
| GSR Mortgage Loan Trust 4,440 % fällig am 25.11.2035 | 53 | 52 |
| Navient Corp. 8,000 % fällig am 25.03.2020 | 50 | 52 |
| Wachovia Bank Commercial Mortgage Trust 6,308 % fällig am 15.05.2046 | 50 | 51 |
| Structured Asset Mortgage Investments Trust 2,640 % fällig am 19.07.2035 | 53 | 50 |
| Navient Corp. 4,875 % fällig am 17.06.2019 | 50 | 50 |
| Avolon Holdings Funding Ltd. 3,625 % fällig am 01.05.2022 | 50 | 50 |
| Countrywide Alternative Loan Trust 3,504 % fällig am 25.12.2035 | 52 | 48 |
| CD Mortgage Trust 6,431 % fällig am 15.11.2044 | 47 | 47 |
| Countrywide Alternative Loan Trust 5,915 % fällig am 25.11.2035 | 60 | 46 |
| Banc of America Alternative Loan Trust 6,000 % fällig am 25.03.2021 | 43 | 38 |

| BESCHREIBUNG | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | 38.504 | $ 385 |
| | **PARI (000S)** | |
| GSMPS Mortgage Loan Trust 7,500 % fällig am 25.01.2036 | $ 99 | 105 |
| Edison International 5,750 % fällig am 15.06.2027 | 100 | 103 |
| Norbord, Inc. 5,750 % fällig am 15.07.2027 | 100 | 101 |
| Avolon Holdings Funding Ltd. 3,625 % fällig am 01.05.2022 | 50 | 50 |

(a) Der PIMCO StocksPLUS™ AR Fund legt in Anteile eines verbundenen Teilfonds an.

(b) Der Kapitalbetrag des Wertpapiers ist inflationsbereinigt.

Wesentliche Portfolioänderungen sind definiert als Wert der Käufe, die über 1 % der Gesamtkaufkosten hinausgehen, sowie als Verkäufe, die 1 % der Gesamterlöse überschreiten. Es müssen mindestens die zwanzig größten Käufe und Verkäufe oder Fälligkeiten dargestellt werden. Falls weniger Transaktionen getätigt wurden, sind sämtliche dieser Transaktionen offengelegt.

Pensionsgeschäfte, die für nicht angelegte Teilfondsbarmittel genutzt werden können und gewöhnlich am nächsten Geschäftstag fällig sind, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Strategic Income Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 21.652.686 | $ | 216.793 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.12.2020 | $ | 43.000 | | 42.570 |
| Paragon Mortgages PLC 1,760 % fällig am 15.05.2045 | £ | 13.900 | | 17.622 |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.01.2026 | $ | 14.900 | | 14.996 |
| Argentina Government International Bond 63,705 % fällig am 21.06.2020 | ARS | 217.040 | | 5.344 |
| Warwick Finance Residential Mortgages PLC 1,775 % fällig am 21.09.2049 | £ | 3.686 | | 4.819 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029(b) | $ | 4.624 | | 4.762 |
| U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 3.500 | | 3.628 |
| | | **AKTIEN** | | |
| Royal Dutch Shell PLC 'A' | | 111.702 | | 3.532 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Banca Carige SpA 1,090 % fällig am 25.02.2021 | € | 2.800 | | 3.160 |
| Peru Government International Bond 6,150 % fällig am 12.08.2032 | PEN | 8.177 | | 2.590 |
| Turkey Government International Bond 7,625 % fällig am 26.04.2029 | $ | 2.000 | | 2.029 |
| | | **AKTIEN** | | |
| Wells Fargo & Co. | | 33.277 | | 1.589 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Fannie Mae UMBS 3,500 % fällig am 01.04.2048 | $ | 1.486 | | 1.505 |
| Fannie Mae UMBS 4,000 % fällig am 01.12.2048 | | 981 | | 1.006 |
| Freddie Mac UMBS 4,000 % fällig am 01.08.2048 | | 976 | | 1.006 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 4,445 % fällig am 08.05.2030 | | 1.000 | | 1.000 |
| QNB Finance Ltd. 3,500 % fällig am 28.03.2024 | | 1.000 | | 991 |
| | | **AKTIEN** | | |
| Exxon Mobil Corp. | | 12.182 | | 928 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Fannie Mae UMBS 3,500 % fällig am 01.07.2048 | $ | 903 | | 920 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 14.142.912 | | $ 141.600 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 31.12.2020 | $ | 79.200 | | 78.444 |
| U.S. Treasury Notes 1,875 % fällig am 28.02.2022 | | 14.800 | | 14.705 |
| Aroundtown S.A. 1,625 % fällig am 31.01.2028 | € | 3.400 | | 3.693 |
| | | **AKTIEN** | | |
| Royal Dutch Shell PLC 'A' | | 107.285 | | 3.357 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 30.11.2021 | $ | 3.000 | | 2.966 |
| BNP Paribas S.A. 3,375 % fällig am 09.01.2025 | | 1.900 | | 1.813 |
| Financial & Risk U.S. Holdings, Inc. 3,773 % fällig am 09.01.2025 | | 998 | | 1.126 |
| | | **AKTIEN** | | |
| Exxon Mobil Corp. | | 14.248 | | 1.102 |
| Wal-Mart Stores, Inc. | | 10.028 | | 981 |
| Pfizer, Inc. | | 20.612 | | 875 |
| iShares Core MSCI Japan IMI UCITS ETF | | 21.000 | | 852 |
| Verizon Communications, Inc. | | 13.817 | | 790 |
| HCA Healthcare, Inc. | | 5.602 | | 730 |
| Chevron Corp. | | 5.942 | | 721 |
| RWE AG | | 32.647 | | 700 |
| AT&T, Inc. | | 20.002 | | 624 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Emirate of Abu Dhabi Government International Bond 4,125 % fällig am 11.10.2047 | $ | 600 | | 597 |

(a) Der Strategic Income 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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des Total Return Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 19.614.743 | $ 196.393 |
| | | **PARI (000S)** | |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,875 % fällig am 15.01.2029 (b) | $ | 135.703 | 139.935 |
| Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.02.2049 | | 64.548 | 64.449 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2026 (b) | | 57.642 | 56.230 |
| American Express Co. 2,750 % fällig am 20.05.2022 | | 54.800 | 54.734 |
| Volkswagen Bank GmbH 1,875 % fällig am 31.01.2024 | € | 42.100 | 48.204 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 1,855 % fällig am 20.10.2051 | £ | 29.000 | 38.338 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,500 % fällig am 15.04.2024 (b) | $ | 35.744 | 35.883 |
| Spain Government International Bond 1,450 % fällig am 30.04.2029 | € | 22.700 | 27.836 |
| Spain Government International Bond 0,600 % fällig am 31.10.2029 | | 22.600 | 25.510 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | $ | 25.793 | 25.490 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 1,000 % fällig am 15.02.2046 (b) | | 23.168 | 24.095 |
| Mulcair Securities DAC 0,695 % fällig am 24.04.2071 | € | 21.000 | 23.627 |
| Ginnie Mae 4,500 % fällig am 20.06.2048 | $ | 21.862 | 22.867 |
| RCI Banque S.A. 2,000 % fällig am 11.07.2024 | € | 18.600 | 21.107 |
| Volkswagen Bank GmbH 1,250 % fällig am 01.08.2022 | | 15.800 | 17.917 |
| U.S. Treasury Notes 1,750 % fällig am 30.06.2024 | $ | 16.700 | 16.667 |
| Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.01.2049 | | 15.560 | 16.276 |
| Ginnie Mae 5,000 % fällig am 20.05.2049 | | 14.487 | 15.236 |
| Volkswagen Financial Services AG 0,489 % fällig am 15.02.2021 | € | 12.900 | 14.546 |
| Landesbank Baden-Wuerttemberg 2,375 % fällig am 31.05.2022 | $ | 14.200 | 14.156 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 23.215.576 | $ 232.400 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.11.2048 | $ | 141.261 | 144.307 |
| BNG Bank NV 2,500 % fällig am 28.02.2020 | | 80.000 | 79.872 |
| Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.02.2049 | | 64.350 | 64.441 |
| Province of Ontario 4,000 % fällig am 02.06.2021 | CAD | 63.400 | 49.673 |
| Freddie Mac 4,000 % fällig am 01.09.2048 | $ | 35.762 | 36.533 |
| Dexia Credit Local S.A. 2,500 % fällig am 25.01.2021 | | 31.900 | 31.828 |
| Province of Quebec 4,250 % fällig am 01.12.2021 | CAD | 34.900 | 27.764 |
| AT&T, Inc. 3,086 % fällig am 15.01.2020 | $ | 24.900 | 24.990 |
| Province of Ontario 1,650 % fällig am 27.09.2019 | | 24.000 | 23.823 |
| Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 5,350 % fällig am 11.03.2024 | | 22.400 | 23.713 |
| Province of Ontario 4,400 % fällig am 14.04.2020 | | 22.300 | 22.719 |
| SNCF Reseau 2,000 % fällig am 13.10.2020 | | 19.700 | 19.529 |
| Royal Bank of Canada 2,100 % fällig am 14.10.2020 | | 19.100 | 18.824 |
| Royal Bank of Canada 2,300 % fällig am 22.03.2021 | | 17.600 | 17.484 |
| National Australia Bank Ltd. 2,250 % fällig am 16.03.2021 | | 17.500 | 17.366 |
| Barclays PLC 1,500 % fällig am 03.09.2023 | € | 14.800 | 16.868 |
| Golden Credit Card Trust 2,855 % fällig am 15.02.2021 | $ | 15.000 | 15.001 |
| JPMorgan Chase Bank N.A. 3,086 % fällig am 26.04.2021 | | 15.000 | 14.932 |
| Citigroup, Inc. 3,761 % fällig am 01.06.2024 | | 14.600 | 14.589 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 4,519 % fällig am 25.06.2024 | | 14.200 | 14.559 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 2,500 % fällig am 22.03.2023 | € | 10.700 | 12.631 |
| CVS Health Corp. 4,300 % fällig am 25.03.2028 | $ | 12.600 | 12.603 |
| Fannie Mae 3,500 % fällig am 01.01.2049 | | 11.960 | 11.977 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.11.2021 | $ | 8.200 | $ 8.279 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 333.208 | 3.337 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2022 | $ | 1.600 | 1.598 |
| **Morgan Stanley** | | | |
| 3,722 % fällig am 20.01.2022 | | 700 | 708 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 3,363 % fällig am 31.10.2022 | | 620 | 620 |
| **Citibank N.A.** | | | |
| 3,123 % fällig am 20.05.2022 | | 300 | 300 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,875 % fällig am 15.11.2021 | $ | 8.200 | $ 8.280 |
| | | **AKTIEN** | |
| **PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)** | | 544.273 | 5.450 |
| | | **PARI (000S)** | |
| **U.S. Treasury Notes** | | | |
| 2,500 % fällig am 15.01.2022 | $ | 1.600 | 1.598 |
| **Morgan Stanley** | | | |
| 3,772 % fällig am 20.01.2022 | | 700 | 707 |
| **AT&T, Inc.** | | | |
| 3,418 % fällig am 15.02.2023 | | 700 | 685 |
| **JPMorgan Chase & Co.** | | | |
| 3,866 % fällig am 07.06.2021 | | 500 | 507 |
| **Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.** | | | |
| 3,244 % fällig am 19.09.2019 | | 500 | 501 |
| **Toyota Motor Credit Corp.** | | | |
| 3,040 % fällig am 17.05.2022 | | 500 | 497 |
| **EQT Corp.** | | | |
| 3,089 % fällig am 01.10.2020 | | 500 | 493 |
| **Macquarie Bank Ltd.** | | | |
| 2,600 % fällig am 24.06.2019 | | 400 | 400 |
| **Lloyds Banking Group PLC** | | | |
| 7,000 % fällig am 27.06.2019 | £ | 250 | 319 |
| **Sempra Energy** | | | |
| 2,860 % fällig am 15.03.2021 | $ | 300 | 296 |
| **Goldman Sachs Group, Inc.** | | | |
| 3,940 % fällig am 23.04.2021 | | 200 | 203 |
| **Banco Santander Chile** | | | |
| 3,380 % fällig am 25.07.2020 | | 200 | 200 |
| **Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.** | | | |
| 3,370 % fällig am 25.07.2022 | | 200 | 199 |
| **Conagra Brands, Inc.** | | | |
| 3,092 % fällig am 09.10.2020 | | 200 | 199 |
| **Nissan Motor Acceptance Corp.** | | | |
| 3,247 % fällig am 13.07.2022 | | 200 | 198 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des UK Corporate Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 158.500 | £ | 16.166 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.07.2019 | £ | 4.410 | | 4.419 |
| Deutsche Bank AG 3,875 % fällig am 12.02.2024 | | 3.900 | | 3.875 |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC 2,500 % fällig am 02.05.2025 | | 3.400 | | 3.376 |
| HSBC Holdings PLC 3,000 % fällig am 29.05.2030 | | 3.000 | | 2.988 |
| HSBC Holdings PLC 3,000 % fällig am 22.07.2028 | | 2.900 | | 2.882 |
| General Electric Co. 5,250 % fällig am 07.12.2028 | | 2.300 | | 2.699 |
| BNP Paribas S.A. 3,375 % fällig am 23.01.2026 | | 2.700 | | 2.697 |
| New York Life Global Funding 1,625 % fällig am 15.12.2023 | | 2.600 | | 2.599 |
| Bristol-Myers Squibb Co. 3,200 % fällig am 15.06.2026 | $ | 3.400 | | 2.598 |
| Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % fällig am 27.11.2026 | £ | 2.400 | | 2.410 |
| GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 04.11.2020 | | 2.200 | | 2.337 |
| Clarion Funding PLC 2,625 % fällig am 18.01.2029 | | 2.300 | | 2.281 |
| Wells Fargo & Co. 2,500 % fällig am 02.05.2029 | | 2.100 | | 2.094 |
| Wells Fargo & Co. 2,000 % fällig am 28.07.2025 | | 2.100 | | 2.070 |
| Berkshire Hathaway Finance Corp. 2,375 % fällig am 19.06.2039 | | 2.100 | | 2.067 |
| Electricite de France S.A. 4,500 % fällig am 21.09.2028 | $ | 2.600 | | 1.982 |
| AXA S.A. 5,453 % fällig am 04.03.2026 | £ | 1.800 | | 1.974 |
| Aroundtown S.A. 3,625 % fällig am 10.04.2031 | | 2.000 | | 1.956 |
| Electricite de France S.A. 6,125 % fällig am 02.06.2034 | | 1.400 | | 1.952 |
| Fiserv, Inc. 2,250 % fällig am 01.07.2025 | | 1.900 | | 1.909 |
| American Water Capital Corp. 3,450 % fällig am 01.06.2029 | $ | 2.500 | | 1.905 |
| Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 27.03.2037 | £ | 1.400 | | 1.828 |
| Fidelity National Information Services, Inc. 2,602 % fällig am 21.05.2025 | | 1.700 | | 1.700 |
| Glencore Finance Europe Ltd. 3,125 % fällig am 26.03.2026 | | 1.600 | | 1.595 |
| Vodafone Group PLC 3,375 % fällig am 08.08.2049 | | 1.700 | | 1.588 |
| TP ICAP PLC 5,250 % fällig am 29.05.2026 | | 1.500 | | 1.500 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 1.500 | | 1.500 |
| Deutsche Bahn Finance GmbH 1,875 % fällig am 13.02.2026 | | 1.500 | | 1.497 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 3,125 % fällig am 28.03.2027 | | 1.500 | | 1.490 |
| Ford Motor Credit Co. LLC 4,535 % fällig am 06.03.2025 | | 1.400 | | 1.400 |
| BP Capital Markets PLC 1,827 % fällig am 08.09.2025 | | 1.400 | | 1.400 |
| Citigroup, Inc. 2,750 % fällig am 24.01.2024 | | 1.400 | | 1.397 |
| ING Groep NV 3,000 % fällig am 18.02.2026 | | 1.400 | | 1.392 |
| Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,150 % fällig am 23.01.2025 | $ | 1.700 | | 1.329 |
| Orsted A/S 2,125 % fällig am 17.05.2027 | £ | 1.300 | | 1.294 |
| Southern Electric Power Distribution PLC 5,500 % fällig am 07.06.2032 | | 1.000 | | 1.273 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 219.800 | £ | 22.443 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.07.2019 | £ | 4.410 | | 4.418 |
| Bristol-Myers Squibb Co. 3,200 % fällig am 15.06.2026 | $ | 3.400 | | 2.759 |
| Volkswagen International Finance NV 3,375 % fällig am 16.11.2026 | £ | 2.500 | | 2.532 |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 3,950 % fällig am 05.06.2020 | | 2.500 | | 2.521 |
| Deutsche Bank AG 3,875 % fällig am 12.02.2024 | | 2.100 | | 2.109 |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC 2,500 % fällig am 02.05.2025 | | 2.100 | | 2.094 |
| Anheuser-Busch InBev S.A. 2,85 % fällig am 24.05.2029 | | 2.000 | | 1.948 |
| GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % fällig am 04.11.2020 | | 1.700 | | 1.801 |
| Deutsche Bank AG 1,875 % fällig am 28.02.2020 | | 1.800 | | 1.785 |
| Barclays Bank PLC 7,625 % fällig am 21.11.2022 | $ | 1.900 | | 1.630 |
| Virgin Media Receivables Financing Notes DAC 5,500 % fällig am 15.09.2024 | £ | 1.300 | | 1.337 |
| Clarion Funding PLC 2,625 % fällig am 18.01.2029 | | 1.300 | | 1.336 |
| Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 4,150 % fällig am 23.01.2025 | $ | 1.700 | | 1.331 |
| Abertis Infraestructuras 3,375 % fällig am 27.11.2026 | £ | 1.300 | | 1.302 |
| Volkswagen Financial Services NV 1,875 % fällig am 07.09.2021 | | 1.300 | | 1.283 |
| Deutsche Bank AG 4,250 % fällig am 14.10.2021 | $ | 1.500 | | 1.146 |
| Electricite de France SA 5,500 % fällig am 17.10.2041 | £ | 800 | | 1.111 |
| Cooperatieve Rabobank UA 6,875 % fällig am 19.03.2020 | € | 1.150 | | 1.081 |
| Wellcome Trust Finance PLC 4,625 % fällig am 25.07.2036 | £ | 750 | | 1.047 |
| BNP Paribas S.A. 4,400 % fällig am 10.01.2025 | $ | 1.300 | | 1.020 |
| New York Life Global Funding 1,625 % fällig am 15.12.2023 | £ | 1.000 | | 1.012 |
| ADLER Real Estate AG 1,875 % fällig am 27.04.2023 | € | 1.200 | | 1.010 |
| British Telecommunications PLC 3,125 % fällig am 21.11.2031 | £ | 1.000 | | 1.010 |
| Lloyds Banking Group PLC 2,250 % fällig am 16.10.2024 | | 1.000 | | 993 |
| GE Capital UK Funding Unlimited Co 5,875 % fällig am 18.01.2033 | | 800 | | 981 |
| HSBC Bank PLC 5,375 % fällig am 04.11.2030 | | 850 | | 970 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des UK Long Term Corporate Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 421.000 | £ | 42.956 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 27.03.2037 | £ | 3.700 | | 4.691 |
| Deutsche Bank AG 3,875 % fällig am 12.02.2024 | | 4.600 | | 4.571 |
| United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 07.09.2019 | | 4.110 | | 4.142 |
| United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.07.2019 | | 3.220 | | 3.225 |
| Charter Communications Operating LLC 5,125 % fällig am 01.07.2049 | $ | 4.100 | | 3.219 |
| innogy Finance BV 4,750 % fällig am 31.01.2034 | £ | 2.100 | | 2.625 |
| HSBC Holdings PLC 3,000 % fällig am 29.05.2030 | | 2.600 | | 2.590 |
| Goldman Sachs Group, Inc. 3,125 % fällig am 25.07.2029 | | 2.400 | | 2.451 |
| Enel Finance International NV 5,750 % fällig am 14.09.2040 | | 1.800 | | 2.385 |
| Orsted A/S 2,500 % fällig am 16.05.2033 | | 2.200 | | 2.168 |
| AXA S.A. 5,453 % fällig am 04.03.2026 | | 1.900 | | 2.084 |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC 2,500 % fällig am 02.05.2025 | | 2.000 | | 1.986 |
| Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 5,550 % fällig am 23.01.2049 | $ | 2.500 | | 1.950 |
| Fidelity National Information Services, Inc. 3,360 % fällig am 21.05.2031 | £ | 1.800 | | 1.800 |
| National Grid Electricity Transmission PLC 2,750 % fällig am 06.02.2035 | | 1.800 | | 1.795 |
| Aroundtown S.A. 5,375 % fällig am 21.03.2029 | $ | 2.200 | | 1.643 |
| Fiserv, Inc. 3,000 % fällig am 01.07.2031 | £ | 1.600 | | 1.623 |
| Manchester Airport Group Funding PLC 2,875 % fällig am 30.09.2044 | | 1.600 | | 1.573 |
| Wells Fargo & Co. 4,625 % fällig am 02.11.2035 | | 1.200 | | 1.546 |
| Verizon Communications, Inc. 2,500 % fällig am 08.04.2031 | | 1.500 | | 1.494 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 1,855 % fällig am 20.10.2051 | | 1.450 | | 1.450 |
| Barclays PLC 8,000 % fällig am 15.06.2024 | $ | 1.900 | | 1.441 |
| Berkshire Hathaway Finance Corp. 2,625 % fällig am 19.06.2059 | £ | 1.400 | | 1.389 |
| Royal Bank of Scotland Group PLC 3,125 % fällig am 28.03.2027 | | 1.300 | | 1.292 |

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | | |
| PIMCO Fixed Income Source ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity Source UCITS ETF (a) | | 310.000 | £ | 31.646 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| United Kingdom Gilt 3,750 % fällig am 07.09.2019 | £ | 4.110 | | 4.140 |
| United Kingdom Gilt 1,750 % fällig am 22.07.2019 | | 3.220 | | 3.225 |
| Deutsche Bank AG 3,875 % fällig am 12.02.2024 | | 3.100 | | 3.112 |
| Bank of America Corp. 7,000 % fällig am 31.07.2028 | | 1.950 | | 2.687 |
| Kraft Heinz Foods Co. 4,125 % fällig am 01.07.2027 | | 2.300 | | 2.447 |
| Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc. 5,550 % fällig am 23.01.2049 | $ | 2.500 | | 1.948 |
| Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 27.03.2037 | £ | 1.500 | | 1.910 |
| E.ON International Finance BV 5,875 % fällig am 30.10.2037 | | 1.300 | | 1.815 |
| Volkswagen International Finance NV 4,125 % fällig am 17.11.2031 | | 1.800 | | 1.812 |
| BAT International Finance PLC 2,250 % fällig am 09.09.2052 | | 2.550 | | 1.771 |
| Tesco Corporate Treasury Services PLC 2,500 % fällig am 02.05.2025 | | 1.600 | | 1.597 |
| HSBC Bank PLC 5,375 % fällig am 22.08.2033 | | 1.277 | | 1.563 |
| Land Securities Capital Markets PLC 2,399 % fällig am 08.02.2029 | | 1.500 | | 1.531 |
| Deutsche Bank AG 4,250 % fällig am 14.10.2021 | $ | 2.000 | | 1.528 |
| Electricite de France S.A. 5,500 % fällig am 17.10.2041 | £ | 1.000 | | 1.384 |
| ADLER Real Estate AG 1,875 % fällig am 27.04.2023 | € | 1.500 | | 1.262 |
| Telereal Secured Finance PLC 4,010 % fällig am 10.12.2031 | £ | 1.142 | | 1.221 |
| Comcast Corp. 5,500 % fällig am 23.11.2029 | | 950 | | 1.214 |
| HSBC Bank PLC 5,375 % fällig am 04.11.2030 | | 1.000 | | 1.141 |
| HSBC Holdings PLC 3,000 % fällig am 22.07.2028 | | 1.100 | | 1.129 |
| Riverside Finance PLC 3,875 % fällig am 05.12.2044 | | 900 | | 1.061 |
| British Land Co. PLC 2,375 % fällig am 14.09.2029 | | 1.000 | | 979 |
| BNP Paribas S.A. 4,705 % fällig am 10.01.2025 | $ | 1.200 | | 942 |
| Virgin Media Receivables Financing Notes DAC 5,500 % fällig am 15.09.2024 | £ | 900 | | 926 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US High Yield Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | |
| Avantor, Inc. 9,000 % fällig am 01.10.2025 | $ | 10.250 | $ 10.739 |
| Clear Channel Worldwide Holdings, Inc. 9,250 % fällig am 15.02.2024 | | 10.500 | 10.500 |
| Envision Healthcare Corp. 8,750 % fällig am 15.10.2026 | | 10.000 | 9.291 |
| Ascend Learning LLC 6,875 % fällig am 01.08.2025 | | 8.000 | 7.684 |
| Dun & Bradstreet Corp. 10,250 % fällig am 15.02.2027 | | 7.250 | 7.345 |
| Staples, Inc. 7,500 % fällig am 15.04.2026 | | 7.000 | 6.995 |
| Eagle Holding Co. LLC (7,750 % bar oder 7,750 % PIK) 7,750 % fällig am 15.05.2022 | | 6.500 | 6.435 |
| USI, Inc. 6,875 % fällig am 01.05.2025 | | 6.500 | 6.344 |
| Refinitiv U.S. Holdings, Inc. 8,250 % fällig am 15.11.2026 | | 6.250 | 6.291 |
| Vizient, Inc. 6,250 % fällig am 15.05.2027 | | 6.000 | 6.018 |
| BCPE Cycle Merger Sub, Inc. 10,625 % fällig am 15.07.2027 | | 5.750 | 5.750 |
| Nidda BondCo GmbH 5,000 % fällig am 30.09.2025 | € | 5.000 | 5.493 |
| Core & Main LP 6,125 % fällig am 15.08.2025 | $ | 5.500 | 5.443 |
| Immucor, Inc. 11,125 % fällig am 15.02.2022 | | 5.000 | 5.113 |
| Bausch Health Cos., Inc. 7,000 % fällig am 15.01.2028 | | 5.000 | 5.063 |
| Getty Images, Inc. 9,750 % fällig am 01.03.2027 | | 5.000 | 5.008 |
| | | **AKTIEN** | |
| PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a) | | 482.160 | 5.000 |
| | | **PARI (000S)** | |
| Avantor, Inc. 6,000 % fällig am 01.10.2024 | $ | 4.250 | 4.339 |
| Dun & Bradstreet Corp. 6,875 % fällig am 15.08.2026 | | 4.250 | 4.298 |
| Golden Entertainment, Inc. 7,625 % fällig am 15.04.2026 | | 4.250 | 4.250 |
| CCO Holdings LLC 5,375 % fällig am 01.06.2029 | | 4.000 | 4.030 |
| Hexion, Inc. 7,875 % fällig am 15.07.2027 | | 4.000 | 4.000 |
| Vistra Operations Co. LLC 5,000 % fällig am 31.07.2027 | | 4.000 | 4.000 |
| Fairstone Financial, Inc. 7,875 % fällig am 15.07.2024 | | 4.000 | 3.979 |
| Ally Financial, Inc. 3,875 % fällig am 21.05.2024 | | 4.000 | 3.960 |
| ViaSat, Inc. 5,625 % fällig am 15.09.2025 | | 4.000 | 3.936 |
| Sprint Corp. 7,625 % fällig am 15.02.2025 | | 3.750 | 3.922 |
| Transocean Sentry Ltd. 5,375 % fällig am 15.05.2023 | | 3.850 | 3.831 |
| Prime Security Services Borrower LLC 5,250 % fällig am 15.04.2024 | | 3.750 | 3.766 |
| Refinitiv U.S. Holdings, Inc. 6,250 % fällig am 15.05.2026 | | 3.750 | 3.762 |

| BESCHREIBUNG | PARI (000S) | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | |
| Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % fällig am 15.03.2023 | $7.000 | $ 6.998 |
| Credit Agricole S.A. 7,875 % fällig am 23.01.2024 | 5.000 | 5.363 |
| HCA, Inc. 5,000 % fällig am 15.03.2024 | 5.000 | 5.214 |
| Tronox Finance PLC 5,750 % fällig am 01.10.2025 | 5.500 | 5.208 |
| Park Aerospace Holdings Ltd. 5,250 % fällig am 15.08.2022 | 5.000 | 5.192 |
| HCA, Inc. 4,750 % fällig am 01.05.2023 | 5.000 | 5.125 |
| SBA Communications Corp. 4,000 % fällig am 01.10.2022 | 5.000 | 4.931 |
| B&G Foods, Inc. 5,250 % fällig am 01.04.2025 | 5.000 | 4.875 |
| Newfield Exploration Co. 5,625 % fällig am 01.07.2024 | 4.000 | 4.280 |
| HCA, Inc. 5,250 % fällig am 15.04.2025 | 4.000 | 4.135 |
| Societe Generale S.A. 7,875 % fällig am 18.12.2023 | 4.000 | 4.101 |
| Teck Resources Ltd. 4,500 % fällig am 15.01.2021 | 4.000 | 4.060 |
| Hexion, Inc. 7,875 % fällig am 15.07.2027 | 4.000 | 4.020 |
| Wind Tre SpA 5,000 % fällig am 20.01.2026 | 4.250 | 3.844 |
| Energy Transfer Operating LP 7,500 % fällig am 15.10.2020 | 3.500 | 3.708 |
| First Data Corp. 5,750 % fällig am 15.01.2024 | 3.500 | 3.614 |
| Park Aerospace Holdings Ltd. 5,500 % fällig am 15.02.2024 | 3.000 | 3.180 |
| Newfield Exploration Co. 5,375 % fällig am 01.01.2026 | 3.000 | 3.173 |
| Teck Resources Ltd. 6,125 % fällig am 01.10.2035 | 3.000 | 3.168 |
| Starwood Property Trust, Inc. 4,750 % fällig am 15.03.2025 | 3.000 | 3.000 |
| Navient Corp. 6,125 % fällig am 25.03.2024 | 2.750 | 2.733 |
| Continental Resources, Inc. 5,000 % fällig am 15.09.2022 | 2.700 | 2.711 |
| BWAY Holding Co. 7,250 % fällig am 15.04.2025 | 2.700 | 2.627 |
| Avon Products, Inc. 7,000 % fällig am 15.03.2023 | 2.500 | 2.575 |
| AECOM 5,875 % fällig am 15.10.2024 | 2.500 | 2.550 |
| Tempur Sealy International, Inc. 5,500 % fällig am 15.06.2026 | 2.500 | 2.526 |
| USG Corp. 5,500 % fällig am 01.03.2025 | 2.500 | 2.525 |
| AmeriGas Partners LP 5,500 % fällig am 20.05.2025 | 2.500 | 2.475 |
| Mallinckrodt International Finance S.A. 5,750 % fällig am 01.08.2022 | 2.500 | 2.296 |
| Sprint Corp. 7,875 % fällig am 15.09.2023 | 2.000 | 2.145 |
| HCA, Inc. 5,250 % fällig am 15.06.2026 | 2.000 | 2.093 |
| Energy Transfer LP 5,875 % fällig am 15.01.2024 | 2.000 | 2.093 |
| Constellium NV 6,625 % fällig am 01.03.2025 | 2.000 | 2.083 |
| Boyd Gaming Corp. 6,375 % fällig am 01.04.2026 | 2.000 | 2.073 |
| Teck Resources Ltd. 6,250 % fällig am 15.07.2041 | 2.000 | 2.055 |
| ARD Securities Finance SARL (8,750 % bar oder 8,750 % PIK) 8,750 % fällig am 31.01.2023 | 2.128 | 2.055 |
| LKQ Corp. 4,750 % fällig am 15.05.2023 | 2.000 | 2.010 |
| Schaeffler Finance BV 4,750 % fällig am 15.05.2023 | 2.000 | 1.997 |
| VeriSign, Inc. 4,750 % fällig am 15.07.2027 | 2.000 | 1.990 |
| DaVita, Inc. 5,000 % fällig am 01.05.2025 | 2.000 | 1.955 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US Investment Grade Corporate Bond Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | | |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | $ | 41.680 | $ | 42.010 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 2.027.767 | | 20.305 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049 | $ | 15.127 | | 15.653 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2029 | | 15.478 | | 15.376 |
| U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 28.02.2023 | | 12.400 | | 11.995 |
| Fannie Mae UMBS 3,500 % fällig am 01.02.2049 | | 6.699 | | 6.761 |
| U.S. Treasury Bonds 2,875 % fällig am 15.05.2049 | | 6.305 | | 6.663 |
| U.S. Treasury Bonds [illegible] | | [illegible] | | [illegible] |
| U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 31.05.2024 | | 3.860 | | 3.890 |
| U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.11.2022 | | 3.800 | | 3.761 |
| U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 31.08.2023 | | 3.600 | | 3.660 |
| U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.11.2048 | | 2.710 | | 2.908 |
| Central Nippon Expressway Co. Ltd. 2,091 % fällig am 14.09.2021 | | 2.000 | | 1.955 |
| AstraZeneca PLC 3,190 % fällig am 17.08.2023 | | 1.787 | | 1.781 |
| TP ICAP PLC 5,250 % fällig am 29.05.2026 | £ | 1.300 | | 1.646 |
| Gazprom OAO Via Gaz Capital S.A. 5,150 % fällig am 11.02.2026 | $ | 1.600 | | 1.619 |
| U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.08.2028 | | 1.500 | | 1.544 |
| Avangrid, Inc. 3,800 % fällig am 01.06.2029 | | 1.500 | | 1.532 |
| Bacardi Ltd. 4,500 % fällig am 15.01.2021 | | 1.500 | | 1.526 |
| NTT Finance Corp. 1,900 % fällig am 21.07.2021 | | 1.529 | | 1.497 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | | |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 15.02.2029 | $ | 31.343 | $ | 32.042 |
| U.S. Treasury Notes 1,500 % fällig am 28.02.2023 | | 26.545 | | 25.666 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 1.987.431 | | 19.900 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| U.S. Treasury Notes 3,125 % fällig am 15.11.2028 | $ | 12.841 | | 13.323 |
| U.S. Treasury Notes 2,000 % fällig am 30.11.2022 | | 10.200 | | 10.067 |
| U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.02.2049 | | 9.020 | | 9.765 |
| U.S. Treasury Notes 2,875 % fällig am 15.08.2028 | | 8.015 | | 8.275 |
| U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 31.08.2023 | | 7.200 | | 7.319 |
| Fannie Mae UMBS 3,500 % fällig am 01.02.2049 | | 6.699 | | 6.803 |
| U.S. Treasury Bonds 3,000 % fällig am 15.08.2048 | | 6.445 | | 6.431 |
| U.S. Treasury Notes 2,125 % fällig am 31.12.2022 | | 5.000 | | 4.962 |
| U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 31.05.2023 | | 3.100 | | 3.131 |
| U.S. Treasury Bonds 3,375 % fällig am 15.11.2048 | | 2.710 | | 2.945 |
| EMD Finance LLC 3,250 % fällig am 19.03.2025 | | 2.400 | | 2.442 |
| U.S. Treasury Notes 2,750 % fällig am 30.04.2023 | | 2.400 | | 2.437 |
| Sumitomo Mitsui Banking Corp. 2,440 % fällig am 18.06.2024 | | 1.300 | | 1.313 |
| Citibank N.A. 3,123 % fällig am 20.05.2022 | | 1.300 | | 1.302 |
| U.S. Treasury Notes 2,375 % fällig am 15.05.2029 | | 1.240 | | 1.239 |
| MUFG Union Bank N.A. 3,150 % fällig am 01.04.2022 | | 1.100 | | 1.125 |
| U.S. Treasury Bonds 2,500 % fällig am 15.05.2046 | | 1.200 | | 1.110 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

# Wesentliche Änderungen in der Portfoliozusammensetzung des US Short-Term Fund

30. Juni 2019

| BESCHREIBUNG | | AKTIEN | | KOSTEN (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **KÄUFE BIS ZUM 30. JUNI 2019** | | | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 67.477.418 | $ | 675.593 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.07.2020 | $ | 140.500 | | 140.456 |
| Freddie Mac UMBS 3,500 % fällig am 01.05.2049 | | 42.280 | | 43.198 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 31.804 | | 30.894 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | | 27.484 | | 27.894 |
| HCA, Inc. 6,500 % fällig am 15.02.2020 | | 22.430 | | 23.103 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,250 % fällig am 15.01.2025 (b) | | 19.234 | | 18.692 |
| First Abu Dhabi Bank PJSC 3,551 % fällig am 16.04.2022 | | 17.400 | | 17.400 |
| Finsbury Square PLC 1,910 % fällig am 16.06.2069 | £ | 13.200 | | 17.316 |
| Towd Point Mortgage Funding PLC 1,654 % fällig am 20.05.2045 | | 13.006 | | 17.304 |
| HSBC Holdings PLC 3,520 % fällig am 18.05.2024 | $ | 17.300 | | 17.223 |
| Freddie Mac 2,750 % fällig am 22.05.2024 | | 15.000 | | 14.993 |
| Broadcom Corp. 2,375 % fällig am 15.01.2020 | | 15.000 | | 14.884 |
| Bumper UK Finance PLC 1,310 % fällig am 20.09.2028 | £ | 10.900 | | 13.881 |
| Duke Energy Corp. 3,101 % fällig am 11.03.2022 | $ | 13.400 | | 13.400 |
| AT&T, Inc. 3,616 % fällig am 12.06.2024 | | 13.200 | | 13.271 |
| Bristol-Myers Squibb Co. 2,905 % fällig am 16.05.2022 | | 13.000 | | 13.000 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,625 % fällig am 15.01.2026 (b) | | 11.300 | | 11.555 |
| Nissan Motor Acceptance Corp. 2,987 % fällig am 13.07.2020 | | 10.900 | | 10.863 |
| NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 3,241 % fällig am 25.02.2022 | | 9.700 | | 9.700 |

| BESCHREIBUNG | | PARI (000S) | | ERLÖSE (000S) |
|---|---|---|---|---|
| **VERKÄUFE BIS 30. JUNI 2019** | | | | |
| U.S. Treasury Notes 2,625 % fällig am 31.07.2020 | $ | 844.700 | $ | 844.446 |
| | | **AKTIEN** | | |
| PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a) | | 65.439.131 | | 655.206 |
| | | **PARI (000S)** | | |
| Fannie Mae UMBS 4,000 % fällig am 01.11.2048 | $ | 57.860 | | 59.772 |
| Fannie Mae UMBS 3,500 % fällig am 01.10.2047 | | 41.205 | | 41.572 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,750 % fällig am 15.07.2028 (b) | | 29.839 | | 29.961 |
| Fannie Mae UMBS 4,000 % fällig am 01.07.2048 | | 28.353 | | 29.174 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.07.2024 (b) | | 22.210 | | 22.109 |
| U.S. Treasury Inflation Protected Securities 0,125 % fällig am 15.04.2022 (b) | | 17.278 | | 17.127 |
| Erste Abwicklungsanstalt 2,500 % fällig am 13.03.2020 | | 13.000 | | 12.951 |
| United Technologies Corp. 3,175 % fällig am 16.08.2021 | | 6.300 | | 6.305 |
| Trillium Credit Card Trust 2,756 % fällig am 27.02.2023 | | 6.000 | | 5.998 |
| Dexia Credit Local S.A. 2,250 % fällig am 30.01.2019 | | 5.850 | | 5.849 |
| Alibaba Group Holding Ltd. 2,500 % fällig am 28.11.2019 | | 5.230 | | 5.226 |
| BellSouth LLC 4,266 % fällig am 26.04.2021 | | 5.200 | | 5.200 |
| Tokyo Metropolitan Government 2,125 % fällig am 20.05.2019 | | 5.000 | | 4.989 |
| GM Financial Automobile Leasing Trust 2,890 % fällig am 21.09.2020 | | 4.827 | | 4.832 |
| Japan Finance Organization for Municipalities 2,125 % fällig am 13.04.2021 | | 4.600 | | 4.544 |
| Morgan Stanley 3,095 % fällig am 10.02.2021 | | 4.300 | | 4.309 |
| GMF Floorplan Owner Revolving Trust 3,500 % fällig am 15.09.2023 | | 4.000 | | 4.092 |
| HSBC Holdings PLC 4,181 % fällig am 25.05.2021 | | 4.000 | | 4.087 |

(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, wurden von den wesentlichen Änderungen in der Portfoliozusammensetzung ausgenommen.

## Glossar: (möglicherweise im vorstehenden Abschluss verwendete Abkürzungen)

**Abkürzungen der Kontrahenten:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **AZD** | Australia and New Zealand Banking Group | **FCT** | Credit Suisse Capital LLC | **NGF** | Nomura Global Financial Products, Inc. |
| **BCY** | Barclays Capital, Inc. | **FICC** | Fixed Income Clearing Corporation | **NOM** | Nomura Securities International Inc. |
| **BOA** | Bank of America N.A. | **FOB** | Credit Suisse Securities (USA) LLC | **NXN** | Natixis New York |
| **BOM** | Bank of Montreal | **GLM** | Goldman Sachs Bank USA | **PARI** | Banque Paribas, London |
| **BOS** | Banc of America Securities LLC | **GRE** | RBS Securities, Inc. | **RBC** | Royal Bank of Canada |
| **BPG** | BNP Paribas Securities Corp. | **GSC** | Goldman Sachs & Co. LLC | **RCY** | Royal Bank of Canada |
| **BPS** | BNP Paribas S.A. | **GST** | Goldman Sachs International | **RDR** | RBC Capital Markets LLC |
| **BRC** | Barclays Bank PLC | **HUS** | HSBC Bank USA N.A. | **RVM** | Barclays Capital, Inc. |
| **BSH** | Banco Santander S.A. - New York Branch | **IND** | Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A. | **RYL** | Royal Bank of Scotland Group PLC |
| **BSN** | Bank of Nova Scotia | **JLN** | JP Morgan Chase Bank N.A. London | **SAL** | Citigroup Global Markets, Inc. |
| **BSS** | Banco Santander S.A. | **JML** | JP Morgan Securities Plc | **SBI** | Citigroup Global Markets Ltd. |
| **CBK** | Citibank N.A. | **JPM** | JP Morgan Chase Bank N.A. | **SCX** | Standard Chartered Bank |
| **CFR** | Credit Suisse Securities (Europe) Ltd. | **JPS** | JP Morgan Securities, Inc. | **SGY** | Societe Generale, New York |
| **CIB** | Canadian Imperial Bank of Commerce | **MBC** | HSBC Bank Plc | **SOG** | Societe Generale |
| **CIW** | CIBC World Markets Corp. | **MEI** | Merrill Lynch International | **SSB** | State Street Bank and Trust Co. |
| **CKL** | Citibank N.A. London | **MFK** | Millenium BCP | **TDM** | TD Securities (USA) LLC |
| **DEU** | Deutsche Bank Securities, Inc. | **MSB** | Morgan Stanley Bank, N.A | **TOR** | Toronto Dominion Bank |
| **DUB** | Deutsche Bank AG | **MSC** | Morgan Stanley & Co., Inc. | **UAG** | UBS AG Stamford |
| **FAR** | Wells Fargo Bank National Association | **MYC** | Morgan Stanley Capital Services, Inc. | **UBS** | UBS Securities LLC |
| **FBF** | Credit Suisse International | **MYI** | Morgan Stanley & Co. International PLC | | |

**Währungskürzel:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **AED** | Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate | **GBP (oder £)** | Britisches Pfund | **PHP** | Philippinischer Peso |
| **ARS** | Argentinischer Peso | **HKD** | Hongkong-Dollar | **PLN** | Polnischer Zloty |
| **AUD** | Australischer Dollar | **HUF** | Ungarischer Forint | **RON** | Rumänischer neuer Leu |
| **BRL** | Brasilianischer Real | **IDR** | Indonesische Rupie | **RUB** | Russischer Rubel |
| **CAD** | Kanadischer Dollar | **ILS** | Israelischer Shekel | **SEK** | Schwedische Krone |
| **CHF** | Schweizer Franken | **INR** | Indische Rupie | **SGD** | Singapur-Dollar |
| **CLP** | Chilenischer Peso | **JPY (oder ¥)** | Japanischer Yen | **THB** | Thailändischer Baht |
| **CNH (oder RMB)** | Chinese Renminbi (Offshore) | **KRW** | Südkoreanischer Won | **TRY** | Türkische neue Lira |
| **CNY** | Chinese Renminbi (Mainland) | **KZT** | Kasachischer Tenge | **TWD** | Taiwanesischer Dollar |
| **COP** | Kolumbianischer Peso | **MXN** | Mexikanischer Peso | **UAH** | Ukrainische Hrywnja |
| **CZK** | Tschechische Krone | **MYR** | Malaysischer Ringgit | **USD (oder $)** | US-Dollar |
| **DKK** | Dänische Krone | **NGN** | Nigerianische Naira | **UYU** | Uruguayischer Peso |
| **DOP** | Dominikanischer Peso | **NOK** | Norwegische Krone | **VND** | Vietnamesischer Dong |
| **EGP** | Ägyptisches Pfund | **NZD** | Neuseeländischer Dollar | **ZAR** | Südafrikanischer Rand |
| **EUR (oder €)** | Euro | **PEN** | Peruanischer neuer Sol | | |

**Börsenkürzel:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **BIST** | Borsa Instanbul Exchange | **FTSE** | Financial Times Stock Exchange | | |
| **CBOT** | Chicago Board of Trade | **OTC** | Over the Counter | | |

**Index-/Spread-Kürzel:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **ABX.HE** | Asset-Backed Securities Index - Home Equity | **DAX** | Deutscher Aktien Index 30 | **MTGEFNCL** | FNMA 30-Year Coupon Index |
| **ACS** | Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures Index | **DWRTFT** | Dow Jones Wilshire REIT Total Return Index | **NDUEACWF** | MSCI ACWI Index Future |
| **AMZX** | Alerian MLP Total Return Index | **EAFE** | Europe, Australasia, and Far East Stock Index | **NDUEEGF** | iShares MSCI Emerging Markets ETF |
| **BCOMF1T** | Bloomberg Commodity Index 1-Month Forward Total Return | **ERAEMLT** | eRAFI Emerging Markets Strategy Index | **PrimeX.ARM** | Prime Mortgage-Backed Securities Index - Adjustable Rate Mortgage |
| **BCOMTR** | Bloomberg Commodity Index Total Return | **ERAGDEVT** | Dow Jones Indices Enhanced RAFI Global Developed Index Total Return | **RAFI** | Research Affiliates Fundamental Index |
| **CDX.EM** | Credit Derivatives Index - Emerging Markets | **FRCPXTOB** | Französischer Verbraucherpreisindex ohne Tabak | **S&P 500** | Standard & Poor's 500 Index |
| **CDX.HY** | Credit Derivatives Index - High Yield | **FTSE/MIB** | Index der 40 italienischen Aktien mit der höchsten Liquidität/ Marktkapitalisierung der Borsa Italiana | **SPSIBITR** | S&P Biotechnology Select Industry Index |
| **CDX.IG** | Credit Derivatives Index - Investment Grade | **IBR** | Indicador Bancario de Referencia | **TOPIX** | Tokyo Price Index |
| **CIXBSTR3** | Individuell zusammengestellter Rohstoffindex | **IOS.FN.600.08** | 2008 Fannie Mae 6,0 % Interest Only Synthetic Total Return Swap Index | **TRNGLU** | FTSE EPRA/NAREIT Developed Index Net TRI USD |
| **CMBX** | Commercial Mortgage-Backed Index | **ISDA** | International Swaps and Derivatives Association, Inc. | **UKRPI** | United Kingdom Retail Prices Index |
| **CNREPOFIX** | China Fixing Repo Rates 7-Day | **JMABDEWE** | J.P. Morgan Custom Commodity Index | **USSW10** | 10 Year USSW Rate |
| **CPALEMU** | Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted Index | **KOSPI** | Korea Composite Stock Price Index | **VSTOXX** | Euro Stoxx 50 Volatility Index |
| **CPTFEMU** | Eurozone HICP ex-Tobacco Index | **KOSPI2** | Korea Stock Exchange KOSPI 200 Index | | |
| **CPURNSA** | Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index | **LNG** | Liquefied Natural Gas Index | | |

**Kommunalanleihen- oder Behördenkürzel:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **AGM** | Assured Guaranty Municipal | **BAM** | Build America Mutual Assurance | **GDR** | Global Depositary Receipt |

**Sonstige Kürzel:**

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **ABS** | Asset-Backed Security (forderungsbesichertes Wertpapier) | **HIBOR** | Hong Kong Interbank Offered Rate | **REMIC** | Real Estate Mortgage Investment Conduit |
| **ADR** | American Depositary Receipt | **JIBAR** | Johannesburg Interbank Agreed Rate | **RMBS** | Residential Mortgage-Backed Security |
| **AID** | Agency International Development | **JSC** | Joint Stock Company | **SP - ADR** | Sponsored American Depositary Receipt |
| **ALT** | Alternate Loan Trust | **KLIBOR** | Kuala Lumpur Interbank Offered Rate | **SP - GDR** | Sponsored Global Depositary Receipt |
| **BABs** | Build America Bonds | **KORIBOR** | Korea Interbank Offered Rate | **STIBOR** | Stockholm Interbank Offered Rate |
| **BBR** | Bank Bill Rate | **LIBOR** | London Interbank Offered Rate | **TBA** | To-Be-Announced |
| **BBSW** | Bank Bill Swap Reference Rate | **Lunar** | Monatliche Zahlung auf der Basis von Zeiträumen von jeweils 28 Tagen Ein Jahr besteht aus 13 Zeiträumen | **TBD** | To-Be-Determined |
| **BTP** | Buoni del Tesoro Poliennali | **MSCI** | Morgan Stanley Capital International | **TBD%** | Bei Abrechnung des Darlehens oder zum Zeitpunkt der Finanzierung zu ermittelnder Zinssatz |
| **CBO** | Collateralized Bond Obligation | **NCUA** | National Credit Union Administration | **TELBOR** | Tel Aviv Inter-Bank Offered Rate |
| **CDI** | Brazil Interbank Deposit Rate | **NVDR** | Non-Voting Depositary Receipt (stimmrechtsloser Depositary Receipt) | **THBFIX** | Thai Baht Floating-Rate Fix |
| **CDO** | Collateralised Debt Obligation (besicherte Schuldverschreibungen) | **OAT** | Obligations Assimilables du Trésor | **TIIE** | Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio „Gleichgewichtszinssatz im Interbankengeschäft“ |
| **CHILIBOR** | Chile Interbank Offered Rate | **OIS** | Overnight Index Swap | **U&I** | Up-and-In-Barriere-Option |
| **CLO** | Collateralised Loan Obligation (durch Kreditportfolio besicherte Wertpapiere) | **PIK** | Payment-in-Kind (Sachausschüttung) | **USSW** | USD Swap Spread (halbjährlicher Festzins vs. 3-Month LIBOR) |
| **DAC** | Designated Activity Company | **PRIBOR** | Prague Interbank Offered Rate | **WIBOR** | Warsaw Interbank Offered Rate |
| **EURIBOR** | Euro Interbank Offered Rate | **REIT** | Real Estate Investment Trust (Immobilieninvestmentfonds) | **YOY** | Year-Over-Year (im Vorjahresvergleich) |

# Allgemeine Informationen

**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 Deutschland 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 Deutschland 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, Unit 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 SpA,
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.

**LUXEMBURGISCHE ZAHL- 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 INFORMATIONSSTELLE**
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[1] (Indien)
Ryan P. Blute[1] (USA)
John Bruton (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied) (Irland)
Craig A. Dawson[1] (USA)
David M. Kennedy (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied) (Irland)
Frances Ruane (unabhängiges Verwaltungsratsmitglied) (Irland)

Der Prospekt, Prospektergänzungen, die Gründungsurkunde und Satzung, die wesentlichen Anlegerinformationen sowie Jahres- und Halbjahresberichte können kostenlos beim Repräsentanten oder Agenten eines jeden Rechtsraums bezogen werden.

Eine Kopie der Liste der Portfolioveränderungen in dem am 30. Juni 2019 abgelaufenen Berichtszeitraum kann von den Anlegern kostenlos bei der Verwahrstelle oder den Zahlstellen sowie bei der Zahl- und Informationsstelle in Deutschland und der Vertretungsstelle in der Schweiz bezogen werden.

[1] Mitarbeiter von PIMCO.

**PIMCO Europe Ltd** (Registernummer 2604517) 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 Deutschland GmbH** (Registernummer 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 München, Deutschland), die italienische Zweigniederlassung der PIMCO Deutschland GmbH (Registernummer 10005170963), die spanische Zweigniederlassung der PIMCO Deutschland GmbH (N.I.F. W2765338E) und die schwedische Zweigniederlassung der PIMCO Deutschland GmbH (SCRO Reg. Nr. 516410-9190) 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, die spanische und die schwedische 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 und die schwedische Finanzaufsichtsbehörde (Finansinspektionen) gemäß Kapitel 25 Abschnitt 12-14 des schwedischen Wertpapiermarktgesetzes reguliert. Die von PIMCO Deutschland 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.